

年度报告 - 2020年9月30日 (经审核)

摩根亚洲总收益 债券基金



内地与香港互认基金系列

中国内地代理人:

上投摩根
基金 管 理

基金管理人:

摩根
资 产 管 理

此（等）报告并不构成购买组成本文件内容的任何基金单位之邀请，也不应视作任何宣传。只有基于现时基金说明书（或同等文件）及最近之财务报告（如有）所作之认购方为有效。

本报告可能包含本基金若干并未获认可在中国内地发售或分销之股份类别。投资者应注意，本年度报告中的财务报告内若干数据以综合方法表述，因此当中包括并未在中国内地注册的股份类别之资产。

内容	页
投资组合 - 未经审计	1 - 6
投资组合持有变动表 - 未经审计	7
财务状况表	8
综合收益表	8
可赎回份额持有人应占净资产变动表	9
现金流量表	9
财务报表之附注	10 - 49
独立核数师报告	50 - 51
管理人及受托人的责任声明	52
受托人对份额持有人的报告	52
业绩纪录 - 未经审计	52 - 53
经营与管理	54

投资组合

截至二零二零年九月三十日 (未经审计)

(续)

单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比	单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比
上市投资 (95.9%)					
			Country Garden 6.15% 17/09/25-RegS	美元 7,800,000	8,643,895 0.3
(I) 债务证券 (95.8%)			Country Garden 7.25% 08/04/26-RegS	美元 1,200,000	1,381,068 0.0
巴哈马群岛 (0.5%)			ENN Energy Hldgs 3.25% 07/22-RegS	美元 14,200,000	14,682,780 0.5
Competition Team 3.75% 12/3/24-RegS	美元 15,800,000	16,921,155 0.5	FWD Ltd VRN 0% Perp- RegS	美元 20,300,000	15,351,875 0.5
百慕大 (1.0%)			Goodman HK Fin 4.375% 19/06/24-RegS	美元 8,300,000	9,114,610 0.3
China Oil & Gas 5.5% 25/01/23-RegS	美元 10,500,000	10,889,900 0.4	Goodman HK Finance 3% 22/07/30-RegS	美元 2,300,000	2,401,637 0.1
Hopson Develop Hldgs 7.5% 06/22-RegS	美元 18,600,000	18,917,750 0.6	Greenland HK Hldgs 6% 17/07/21-RegS	美元 11,000,000	11,162,067 0.4
开曼群岛 (11.9%)			Greentown China 4.55% 10/11/20-RegS	美元 1,000,000	1,017,568 0.0
Agile Group Hldgs VRN 7.875%-RegS	美元 16,000,000	16,464,400 0.5	KWG Property 7.875% 09/08/21-RegS	美元 4,900,000	5,066,723 0.2
Azure Orbit IV 3.75% 25/01/23-RegS	美元 12,600,000	13,263,705 0.4	Longfor Grp 3.85% 13/01/32-RegS	美元 2,000,000	2,115,083 0.1
Azure Orbit IV 4% 25/01/28-RegS	美元 700,000	776,953 0.0	Longfor Grp Hldg 4.5% 16/01/28-RegS	美元 11,600,000	12,858,310 0.4
China Aoyuan Group 7.5% 05/21-RegS	美元 7,000,000	7,280,175 0.2	Melco Resorts Fin 5.625% 07/27-RegS	美元 5,200,000	5,416,125 0.2
China Evergrande 6.25% 28/6/21-RegS	美元 3,000,000	2,879,688 0.1	Powerlong Real Est 4.875% 9/21-RegS	美元 2,000,000	1,990,733 0.1
China Evergrande 8.9% 24/05/21-RegS	美元 1,000,000	983,897 0.0	Powerlong Real Est 6.95% 04/21-RegS	美元 3,100,000	3,222,019 0.1
China Overseas 2.375% 2/3/25-RegS	美元 10,100,000	10,360,410 0.3	Powerlong Real Est 7.125%11/22-RegS	美元 6,300,000	6,683,998 0.2
China Overseas Gr 4.875% 06/21-RegS	美元 2,100,000	2,173,416 0.1	Redsun Properties 10.5%3/10/22-RegS	美元 8,000,000	8,672,933 0.3
China Resources VRN 3.75% Perp-RegS	美元 12,400,000	12,792,667 0.4	Redsun Properties 13.5% 12/20-RegS	美元 2,000,000	2,113,500 0.1
China SCE Group 7.45% 04/21-RegS	美元 9,200,000	9,594,118 0.3	Redsun Properties 9.7% 16/4/23-RegS	美元 7,000,000	7,288,808 0.2
China SCE Group 8.75% 15/01/21-RegS	美元 1,000,000	1,024,722 0.0	Ronshine China 10.5% 01/03/22-RegS	美元 2,800,000	2,941,820 0.1
China State Const 3.375% 11/22-RegS	美元 2,000,000	2,085,375 0.1	Ronshine China 7.35% 15/12/23-RegS	美元 10,900,000	10,890,099 0.3
CIFI Hldgs Group 6.7% 23/04/22-RegS	离岸人民币 74,800,000	11,589,337 0.4	Ronshine China 8.75% 25/10/22-RegS	美元 1,800,000	1,910,100 0.1
CIFI Hldgs Group 7.625% 03/21-RegS	美元 3,000,000	3,048,427 0.1	Sands China 5.125% 08/08/25	美元 7,100,000	7,840,140 0.2
CIFI Hldgs Group VRN5.375%Perp-RegS	美元 6,500,000	6,511,388 0.2	Sands China 5.4% 08/08/28	美元 1,800,000	2,029,950 0.1
CK Hutchison Intl 2.5% 8/5/30-RegS	美元 3,500,000	3,716,757 0.1	Shui On Develop 5.5% 03/03/25-RegS	美元 18,300,000	17,749,678 0.6
CK Hutchison Intl 2.75% 6/9/29-RegS	美元 300,000	321,035 0.0	Shui On Develop 6.25% 28/11/21-RegS	美元 7,881,000	8,037,668 0.3
CK Hutchison Intl 3.625% 04/29-RegS	美元 4,200,000	4,838,194 0.2	Sun Hung Kai Prop 3.75% 02/29-RegS	美元 6,000,000	6,800,100 0.2
CNI Capital 3.97% 01/11/22-RegS	离岸人民币 22,100,000	3,313,868 0.1	Sunac China Hldgs 6.5% 9/07/23-RegS	美元 7,600,000	7,577,622 0.2
Country Garden 5.125% 17/01/25-RegS	美元 400,000	423,354 0.0	Sunac China Hldgs 7.95% 08/22-RegS	美元 11,000,000	11,275,046 0.4
Country Garden 5.625% 14/01/30-RegS	美元 4,000,000	4,378,125 0.1	Sunac China Hldgs 8.35%19/4/23-RegS	美元 5,300,000	5,616,543 0.2
Country Garden 5.625% 15/12/26-RegS	美元 6,500,000	7,303,806 0.2	Times China 6.25% 17/01/21-RegS	美元 10,800,000	10,967,370 0.4

投资组合 (续)

截至二零二零年九月三十日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百 分比		单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百 分比
开曼群岛 (续)				SiChuan Railway Inv 3.8%			
Times China Hldgs 10.95%				06/22-RegS	美元 1,100,000	1,124,829	0.0
11/20-RegS	美元 7,000,000	7,316,517	0.2	Zhengzhou Real 3.95%			
Yuzhou Group Hldgs 6%				09/10/22-RegS	美元 7,400,000	7,632,228	0.2
25/10/23-RegS	美元 13,000,000	13,228,800	0.4	哥伦比亚 (0.0%)			
Yuzhou Group Hldgs				Rep of Colombia 4.375%	哥伦比亚比索		
7.375% 1/26-RegS	美元 2,000,000	1,963,958	0.1	21/03/23	500,000,000	134,984	0.0
Yuzhou Group Hldgs 7.9%				Rep of Colombia 7.75%	哥伦比亚比索		
05/21-RegS	美元 2,200,000	2,297,509	0.1	14/04/21	2,185,000,000	600,478	0.0
Yuzhou Group VRN				香港 (10.4%)			
5.375% Perp-RegS	美元 7,900,000	7,594,654	0.2	AIA Group 3.2%			
中国 (12.2%)				16/09/40-RegS	美元 6,000,000	6,182,300	0.2
Agri Dev Bk CN 2.25%	人民币			Anhui Transport 4.875%			
22/04/25	100,000,000	14,041,557	0.5	13/9/21-RegS	美元 1,900,000	1,956,501	0.1
Bank of China 5%				Bank of East Asi			
13/11/24-RegS	美元 10,500,000	11,878,825	0.4	VRN5.625%Perp-RegS	美元 10,400,000	10,702,965	0.3
Bank of China HK 3.625%				Bank of East Asia VRN 4%			
04/29-RegS	美元 6,800,000	7,790,514	0.3	11/26-RegS	美元 22,400,000	23,056,196	0.7
Bank of China VRN 3.6%				Bank of East Asia VRN			
Perp-RegS	美元 22,800,000	23,214,960	0.7	5.5%Perp-RegS	美元 5,000,000	5,084,653	0.2
CCB Life Ins VRN 4.5%				Bank of East			
21/4/77-RegS	美元 20,600,000	20,913,120	0.7	AsiaVRN5.875%Perp-			
CDB Fin Leasing VRN				RegS	美元 2,000,000	2,013,917	0.1
2.875%/9/30-RegS	美元 12,600,000	12,562,069	0.4	Bocom Leasing Man			
China CITIC Bk VRN				4.375% 01/24-RegS	美元 10,300,000	11,192,345	0.4
4.625% 2/29-RegS	美元 10,050,000	10,690,884	0.3	CDBL Funding I 4.25%			
China Constr Bk VRN				02/12/24-RegS	美元 16,000,000	17,801,578	0.6
4.25% 2/29-RegS	美元 8,800,000	9,441,202	0.3	China Clean Energy			
China Constr VRN 2.45%				4.282%12/25-RegS	美元 4,500,000	5,088,475	0.2
24/6/30-RegS	美元 12,600,000	12,768,858	0.4	China Oil & Gas 4.625%			
China Dev Bank No1915	人民币			04/22-RegS	美元 7,900,000	8,124,629	0.3
3.45% 20/9/29	33,000,000	4,727,203	0.2	Chong Hing Bk VRN			
China Dev Bank No2003	人民币			3.876% 07/27-RegS	美元 17,800,000	17,929,910	0.6
3.23% 10/1/25	301,000,000	44,767,516	1.4	Chong Hing Bk VRN 5.7%			
China Dev Bank No2007	人民币			Perp-RegS	美元 5,300,000	5,317,402	0.2
3% 07/08/23	330,000,000	48,306,221	1.6	CITIC Ltd 3.875%			
China Dev Bank No2008	人民币			28/02/27-RegS	美元 14,700,000	16,182,526	0.5
2.89% 22/6/25	215,500,000	31,064,357	1.0	CMB Wing Lung Bk			
China Dev Bank No2012	人民币			VRN3.75%11/27-RegS	美元 12,800,000	13,253,600	0.4
3.34% 14/7/25	109,000,000	16,014,467	0.5	CNAC HK Finbrid VRN			
China Minmetals VRN				3.35% Perp-RegS	美元 28,700,000	28,429,861	0.9
3.75% Perp-RegS	美元 5,000,000	5,172,875	0.2	CNAC HK Finbridge			
ENN Energy 2.625%				3.875% 06/29-RegS	美元 17,000,000	18,235,546	0.6
17/09/30-RegS	美元 6,800,000	6,805,922	0.2	Gemdale Ever 4.95%			
Export-imp Bk CN 2.93%	人民币			26/7/22-RegS	美元 3,400,000	3,455,888	0.1
02/03/25	100,000,000	14,573,596	0.5	Gemdale Ever 5.6%			
ICBC Ltd VRN 3.58% Perp-				14/06/22-RegS	美元 1,400,000	1,446,052	0.0
RegS	美元 15,500,000	15,469,706	0.5	GET Intl Invest 3.75%			
ICBCIL Finance 1.75%				18/07/22-RegS	美元 10,000,000	10,251,042	0.3
25/08/25-RegS	美元 19,800,000	19,815,840	0.6	HK Intl (Qingdao) 3.9%			
Kunming Rail 3.5%				11/22-RegS	美元 7,600,000	7,762,767	0.2
12/12/22-RegS	美元 9,600,000	9,761,157	0.3	HK Intl (Qingdao) 4.25%			
Kunming Traffic Inv 6.2%				12/22-RegS	美元 8,900,000	9,130,621	0.3
6/22-RegS	美元 11,000,000	11,343,078	0.4	Huasing Intl Hldgs 4.5%			
RKPF Overseas 7.875%				03/21-RegS	美元 900,000	910,238	0.0
01/02/23-RegS	美元 1,300,000	1,379,073	0.0	ICBC Asia VRN 4.25%			
Shougang Group 4%				Perp-RegS	美元 16,000,000	16,285,822	0.5
23/05/24-RegS	美元 16,000,000	17,317,156	0.6				

投资组合 (续)

(续)

截至二零二零年九月三十日 (未经审计)

	单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百 分比		单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百 分比
香港 (续)				印度尼西亚 (11.3%)			
ICBCIL Finance 3.625% 19/05/26-RegS	美元 13,000,000	14,406,492	0.5	Adaro Indonesia 4.25% 31/10/24-RegS	美元 9,600,000	9,543,133	0.3
ICBCIL Finance 3.75% 05/03/24-RegS	美元 7,700,000	8,230,363	0.3	Bank Mandiri 4.75% 13/5/25-RegS	美元 3,500,000	3,930,004	0.1
MTR Corp 1.625% 19/08/30-RegS	美元 16,100,000	15,926,053	0.5	Bank Tabungan Negara 4.2% 1/25-RegS	美元 6,300,000	6,356,910	0.2
Weichai Intl HK VRN 3.75% Perp-RegS	美元 16,300,000	16,500,830	0.5	Bk Mandiri Persero3.75%11/4/24- RegS	美元 2,200,000	2,351,202	0.1
Yango Justice Intl 10.25% 3/22-RegS	美元 10,500,000	10,995,090	0.4	Bk Rakyat Indonesia 3.95% 3/24-RegS	美元 1,550,000	1,647,075	0.0
Yango Justice Intl 9.5% 3/4/21-RegS	美元 10,300,000	10,931,619	0.4	Hutama Karya 3.75% 11/05/30-RegS	美元 12,500,000	13,737,792	0.4
Yanlord Land (HK) 6.8% 27/2/24-RegS	美元 4,000,000	4,245,689	0.1	Indonesia Asahan 4.75% 15/5/25-RegS	美元 4,800,000	5,351,733	0.2
印度 (5.0%)				Indonesia Asahan 6.53%15/11/28-RegS	美元 8,625,000	10,749,500	0.3
Adani Green Energy 6.25% 12/24-RegS	美元 2,800,000	3,070,538	0.1	Indonesia Asahan 6.757% 11/48-RegS	美元 14,200,000	18,738,696	0.6
Adani Ports & Sp 3.375%24/7/24-RegS	美元 9,900,000	10,152,759	0.3	Indonesia Govt 8.25% 15/05/29	印尼盾 723,013,000,000	54,423,328	1.7
Adani Ports & Sp 4.2% 04/08/27-RegS	美元 10,200,000	10,308,630	0.3	Indonesia Govt NoFR68 8.375%15/3/34	印尼盾 80,000,000,000	5,779,041	0.2
Adani Renewable 4.625%15/10/39-RegS	美元 2,900,000	2,774,636	0.1	Indonesia Govt NoFR82 7% 15/09/30	印尼盾 190,000,000,000	12,870,889	0.4
Adani Transmiss 4.25% 21/05/36-RegS	美元 2,600,000	2,609,536	0.1	Indonesia Govt NoFR87 6.5% 15/02/31	印尼盾 500,000,000,000	32,896,558	1.1
Adani Transmission 4% 03/08/26-RegS	美元 9,800,000	10,229,676	0.3	Pelabuhan Indonesia 5.375%5/45-RegS	美元 15,000,000	17,645,979	0.6
Bharat Petroleum 4% 08/05/25-RegS	美元 10,940,000	11,649,884	0.4	Pertamina Persero 3.1% 27/8/30-RegS	美元 7,600,000	7,892,600	0.2
Bharat Petroleum 4.375% 01/22-RegS	美元 2,000,000	2,068,725	0.1	Pertamina Persero 4.175% 01/50-RegS	美元 23,100,000	23,515,062	0.8
India Govt Bond 5.22% 15/06/25	印度卢比 2,400,000,000	32,795,424	1.1	Perusahaan Listrik 3% 30/06/30-RegS	美元 11,300,000	11,455,752	0.4
India Govt Bond 7.27% 08/04/26	印度卢比 1,000,000	15,030	0.0	Perusahaan Listrik 3.875% 7/29-RegS	美元 8,600,000	9,294,581	0.3
India Govt Bond 7.68% 15/12/23	印度卢比 1,100,000,000	16,446,720	0.5	Perusahaan Listrik 4% 30/06/50-RegS	美元 23,300,000	23,541,414	0.8
Indian Oil Corp 4.75% 16/01/24-RegS	美元 2,000,000	2,154,692	0.1	Perusahaan Listrik 5.375%01/29-RegS	美元 7,000,000	8,302,729	0.3
Indian Railway Fin 3.249% 2/30-RegS	美元 5,000,000	5,061,410	0.2	Perusahaan Penerbit 2.8% 06/30-RegS	美元 7,800,000	8,114,123	0.3
Indian Railway Fin3.73%29/3/24-RegS	美元 6,100,000	6,415,353	0.2	Perusahaan Penerbit 3.8% 06/50-RegS	美元 4,600,000	4,965,904	0.2
JSW Steel 5.25% 13/04/22-RegS	美元 3,600,000	3,715,200	0.1	Perusahaan Penerbit 4.4% 03/28-RegS	美元 16,100,000	18,491,923	0.6
JSW Steel 5.95% 18/04/24-RegS	美元 4,000,000	4,217,761	0.1	Perusahaan Penerbit 4.45% 2/29-RegS	美元 3,200,000	3,724,058	0.1
Jubilant Pharma 6% 05/03/24-RegS	美元 10,200,000	10,730,740	0.4	Rep of Indonesia 3.5% 14/02/50	美元 17,000,000	18,149,531	0.6
NTPC Ltd 3.75% 03/04/24-RegS	美元 3,700,000	3,914,754	0.1	Rep of Indonesia 3.7% 30/10/49	美元 6,000,000	6,553,017	0.2
Oil India 5.125% 04/02/29-RegS	美元 3,250,000	3,516,547	0.1	Rep of Indonesia 3.85% 15/10/30	美元 8,000,000	9,218,422	0.3
Power Fin Corp 3.75% 06/12/27-RegS	美元 4,300,000	4,306,575	0.1	韩国 (5.1%)			
Renew Power Syn 6.67% 12/03/24-RegS	美元 9,600,000	10,000,035	0.3	Busan Bank 3.625% 25/07/26-RegS	美元 22,700,000	24,283,230	0.8

投资组合 (续)

截至二零二零年九月三十日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比
韩国 (续)				Neerg Energy 6% 13/02/22-RegS			
Hanwha Life Insur VRN 4.7%Perp-RegS	美元 2,200,000	2,316,881	0.1	美元 15,100,000	15,251,755	0.5	
Hanwha Total Petro 3.875% 1/24-RegS	美元 3,000,000	3,235,948	0.1	墨西哥 (1.1%)			
Heungkuk Life VRN 4.475% 11/47-RegS	美元 22,500,000	22,999,531	0.7	Mexican Bds Desarr NoM20 8.5% 05/29	墨西哥比索 6,055,400	33,331,532	1.1
Hyundai Cap 3% 06/03/22-RegS	美元 1,100,000	1,133,257	0.0	荷兰 (1.3%)			
Industrial BK KR VRN 3.9% Perp-RegS	美元 3,200,000	3,284,800	0.1	Indo Energy Fin II 6.375% 1/23-RegS	美元 10,400,000	5,864,953	0.2
Kookmin Bank 4.5% 01/02/29-RegS	美元 9,900,000	11,581,020	0.4	Minejesa Capital 4.625% 08/30-RegS	美元 16,000,000	16,554,433	0.5
Korea East-West Pwr1.75% 05/25-RegS	美元 10,580,000	11,023,816	0.4	Royal Capital VRN 4.875% Perp-RegS	美元 17,200,000	17,631,218	0.6
NongHyup Bank 1.25% 20/07/25-RegS	美元 7,500,000	7,593,115	0.2	巴基斯坦 (0.8%)			
Shinhan Bank 3.75% 20/09/27-RegS	美元 8,000,000	8,739,567	0.3	Islamic Rep Pakistan 8.25%4/24-RegS	美元 5,000,000	5,498,708	0.2
Shinhan Fin Grp VRN 3.34% 2/30-RegS	美元 17,200,000	18,170,004	0.6	Islamic Rep Pakistan6.875%12/27R egS	美元 19,500,000	19,889,079	0.6
Shinhan Fin VRN 5.875% Perp-RegS	美元 8,000,000	8,652,507	0.3	菲律宾 (1.7%)			
Woori Bank VRN 4.25% Perp-RegS	美元 26,900,000	28,109,043	0.9	Megaworld Corp 4.125% 30/07/27-RegS	美元 18,400,000	18,552,528	0.6
Woori Bank VRN 5.25% Perp-RegS	美元 5,900,000	6,260,711	0.2	Metropolitan Bank 2.125% 01/26-RegS	美元 17,000,000	16,969,164	0.6
卢森堡 (0.2%)				PLDT Inc 2.5% 23/01/31- RegS	美元 3,600,000	3,727,100	0.1
SPIC Lux Energy 4.65% 30/10/23-RegS	美元 5,800,000	6,380,430	0.2	Rizal Comm Bank VRN 6.5% Perp-RegS	美元 11,000,000	11,069,728	0.4
马来西亚 (2.9%)				Rizal Comm Banking 4.125% 3/23-RegS	美元 450,000	473,026	0.0
GOHL Capital 4.25% 24/01/27-RegS	美元 6,400,000	6,435,582	0.2	SMC Global Power VRN5.95% Perp-RegS	美元 1,100,000	1,095,744	0.0
Malaysian Govt No0115 3.955% 09/25	林吉特 120,000,000	31,223,624	1.0	新加坡 (5.9%)			
Malaysian Govt No0313 3.48% 15/3/23	林吉特 30,000,000	7,487,100	0.3	Abja Investment 5.45% 24/01/28-RegS	美元 8,700,000	8,537,685	0.3
Malaysian Govt No419 3.828% 5/07/34	林吉特 60,000,000	15,725,962	0.5	BOC Aviation 3.25% 29/04/25-RegS	美元 6,800,000	7,207,131	0.2
Petronas Capital 4.55% 21/4/50-RegS	美元 6,100,000	7,932,698	0.3	DBS Grp Hldgs VRN 3.3% Perp-RegS	美元 9,000,000	9,032,100	0.3
RHB Bank 3.766% 19/02/24-RegS	美元 6,400,000	6,912,279	0.2	GLP Pte 3.875% 04/06/25-RegS	美元 24,600,000	25,599,836	0.8
SD Intl Sukuk 6.3% 09/05/22-RegS	美元 4,500,000	4,116,899	0.1	Indika Energy 5.875% 09/11/24-RegS	美元 12,600,000	11,663,488	0.4
TNB Global Vent 4.851% 1/11/28-RegS	美元 7,100,000	8,586,474	0.3	LLPL Capital Pte 6.875% 4/2/39-RegS	美元 11,800,000	12,938,742	0.4
毛里求斯 (1.5%)				LMIRT Capital 7.25% 19/06/24-RegS	美元 17,008,000	15,890,433	0.5
Azure Power Energy 5.5% 11/22-RegS	美元 5,400,000	5,643,600	0.2	Medco Bell 6.375% 30/01/27-RegS	美元 4,000,000	3,514,608	0.1
Azure Power Solar 5.65% 12/24-RegS	美元 8,750,000	9,287,457	0.3	Medco Platinum 6.75% 30/01/25-RegS	美元 24,600,000	23,835,863	0.8
Greenko Mauritius 6.25%21/2/23-RegS	美元 13,500,000	13,990,650	0.4				
Greenko Solar 5.55% 29/01/25-RegS	美元 3,300,000	3,397,708	0.1				

投资组合 (续)

(续)

截至二零二零年九月三十日 (未经审计)

	单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百 分比		单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百 分比
新加坡 (续)				CCCI Treasure VRN 3.425% Prep-RegS	美元 6,000,000	6,017,433	0.2
OCBC VRN 1.832% 10/09/30-RegS	美元 15,300,000	15,291,106	0.5	CCCI Treasure VRN 3.65% Perp-RegS	美元 4,200,000	4,208,633	0.1
Parkway Pantai VRN 4.25% Perp-RegS	美元 15,600,000	15,789,627	0.5	Chalco HK Inv VRN 4.25% Perp-RegS	美元 5,000,000	5,139,972	0.2
PSA Intl Pte 2.25% 30/04/30-RegS	美元 7,100,000	7,522,006	0.2	Champion Sin VRN 8.125% Perp-RegS	美元 20,000,000	21,156,236	0.7
United Overseas VRN 3.75% 4/29-RegS	美元 8,100,000	8,783,168	0.3	China Cinda Fin 4.375% 08/02/25-Reg	美元 1,900,000	2,114,493	0.1
United Overseas VRN 3.875%PERP-RegS	美元 18,000,000	18,797,175	0.6	China Railway Xunjie 3.25%7/26-RegS	美元 9,500,000	10,359,631	0.3
斯里兰卡 (0.3%)				Chinalco Capital 4% 25/8/21-RegS	美元 1,000,000	1,014,000	0.0
Rep of Sri Lanka 7.55% 03/30-RegS	美元 8,000,000	5,757,833	0.2	Chouzhou Intl Inv 3.15%11/8/23-RegS	美元 14,600,000	14,610,439	0.5
Rep of Sri Lanka 6.25% 27/7/21-RegS	美元 2,000,000	1,783,822	0.1	Chouzhou Intl Inv 4.5% 30/5/22-RegS	美元 4,200,000	4,358,655	0.1
Rep of Sri Lanka 6.85% 3/11/25-RegS	美元 2,000,000	1,476,342	0.0	CLP Power HK Fin 2.125% 06/30-RegS	美元 12,100,000	12,321,690	0.4
国际 (0.4%)				CNPC Global Cap 2% 23/06/30-RegS	美元 30,100,000	30,203,678	1.0
Corp Andina Fomento 6.77%5/28-RegS	哥伦比亚比索 46,000,000,000	12,938,173	0.4	CNPC Global Cap 1.35% 23/06/25-RegS	美元 20,000,000	20,100,700	0.7
泰国 (0.5%)				Dianjian Haiyu VRN 3.45% Perp-RegS	美元 6,400,000	6,391,947	0.2
Kasikornbank VRN 3.343% 10/31-RegS	美元 13,100,000	13,135,660	0.4	Dianjian Haiyu VRN 4.3% Perp-RegS	美元 3,100,000	3,226,523	0.1
Siam Comm Bk 3.9% 11/02/24-RegS	美元 3,300,000	3,577,585	0.1	Easy Tactic 8.125% 11/07/24-RegS	美元 6,800,000	5,842,258	0.2
英国 (0.3%)				Easy Tactic 8.125% 27/02/23-RegS	美元 14,600,000	13,057,125	0.4
St Engineering 1.5% 29/04/25-RegS	美元 6,800,000	6,995,047	0.2	ENN Clean Energy 7.5% 02/21 (RegS)	美元 3,700,000	3,753,958	0.1
Vedanta Res Fin II 8% 23/04/23-RegS	美元 3,500,000	2,874,764	0.1	Expand Lead 6.4% 18/09/21-RegS	美元 10,400,000	10,606,036	0.3
美国 (0.4%)				Fortune Star 5.25% 23/03/22-RegS	美元 3,300,000	3,313,090	0.1
Hyundai Capital 2.375% 10/2/23-RegS	美元 6,700,000	6,905,788	0.2	Fortune Star 5.95% 29/01/23-RegS	美元 12,900,000	13,261,809	0.4
Hyundai Capital 3% 18/03/21-RegS	美元 2,800,000	2,830,053	0.1	Fortune Star 6.75% 02/07/23-RegS	美元 11,900,000	12,565,061	0.4
Hyundai Capital Amer 3.1% 4/22-RegS	美元 2,700,000	2,819,895	0.1	Franshion Brilliant VRN 4%Perp-RegS	美元 16,700,000	17,008,579	0.6
越南 (0.3%)				Gemstones Intl 12% 10/03/23-RegS	美元 15,900,000	16,090,800	0.5
Euro Bank Rec & Dev 1.38% 2/22-RegS	越南盾 180,000,000,000	7,835,101	0.3	Greenland Global 5.9% 12/02/23-RegS	美元 18,400,000	18,134,682	0.6
维京群岛 (20.8%)				Greenland Global 6.25% 12/22-RegS	美元 6,100,000	6,195,948	0.2
Baoxin Auto Fin VRN 5.625%Perp-RegS	美元 1,885,000	1,420,524	0.0	Guangzhou Metro 1.507% 17/9/25-RegS	美元 5,000,000	4,940,730	0.2
Beijing Capital 2.8% 18/3/23-RegS	美元 13,400,000	13,380,049	0.4	Hejun Shunze Invest 11% 4/6/22-RegS	美元 6,400,000	6,772,800	0.2
Bluestar Fin Hldgs 3.375% 7/24-RegS	美元 32,700,000	34,311,497	1.1	HKT Capital No4 3 14/07/26-RegS	美元 7,000,000	7,467,367	0.2
Castle Peak Pwr Fin 2.2% 06/30-RegS	美元 7,200,000	7,380,360	0.2				

投资组合 (续)

(续)

截至二零二零年九月三十日 (未经审计)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比
维京群岛 (续)				Studio City Finance 6% 15/7/25-RegS	美元 7,500,000	7,801,250	0.3
Hopson Capital Intl 6% 17/2/21-RegS	美元 5,000,000	5,007,000	0.2	UHI Capital Ltd 3% 12/06/24-RegS	美元 12,000,000	12,675,640	0.4
Huarong Fin 2017 VRN 4% Perp-RegS	美元 22,100,000	22,785,100	0.7	Wharf REIC Fin 2.375% 07/05/25- RegS	美元 11,600,000	12,026,300	0.4
Huarong Fin 2019 3.375% 02/30-RegS	美元 11,100,000	11,093,548	0.4	Xingsheng BVI 3.375% 25/07/22- RegS	美元 9,800,000	10,142,780	0.3
Huarong Fin 2019 4.5% 29/05/29-RegS	美元 7,500,000	8,208,750	0.3	Xingsheng BVI 4.5% 20/09/21-RegS	美元 1,167,000	1,199,285	0.0
Hysan (MTN) 2.875% 02/06/27-RegS	美元 14,000,000	14,611,149	0.5	Yuexiu REIT MTN 4.75% 27/04/21- RegS	美元 3,100,000	3,212,125	0.1
JIC Zhixin 3.5% 24/11/27- RegS	美元 2,000,000	2,213,094	0.1	Yunda Hldg Inv 2.25% 19/08/25- RegS	美元 3,500,000	3,479,963	0.1
King Power Cap 5.625% 03/11/24-RegS	美元 9,400,000	11,021,735	0.4	ZGC Intl 2.875% 03/02/23-RegS	美元 5,400,000	5,431,061	0.2
Minmetals Boun VRN 3.375% Perp-RegS	美元 5,200,000	5,305,690	0.2			2,970,845,481	95.8
Minmetals Bounteous 4.2% 07/26-RegS	美元 15,000,000	16,957,750	0.5			-----	----
New Metro Glo 7.125% 23/05/21-RegS	美元 5,900,000	6,130,592	0.2				
New Metro Global 6.5% 20/05/22-RegS	美元 1,850,000	1,916,698	0.1				
New Metro Global 6.5% 23/4/21-RegS	美元 8,800,000	9,095,044	0.3				
New Metro Global 7.5% 12/21-RegS	美元 8,000,000	8,355,000	0.3	(II) 衍生性产品 (0.1%)			
NWD MTN Ltd 4.125% 18/07/29-RegS	美元 16,400,000	16,780,719	0.5	远期外汇合约 (0.1%)		1,669,493	0.1
RKPF Overseas 6.7% 30/09/24-RegS	美元 13,100,000	13,502,643	0.4	期货 (-0.0%)			
RongXingDa Dev 8% 24/04/22-RegS	美元 21,300,000	21,519,153	0.7	US Ultra Bond (CBT) Fut 12/20	71	(76,688)	(0.0)
RongXingDa Dev 8.75% 28/01/21-RegS	美元 4,800,000	4,859,167	0.2			1,592,805	0.1
Scenery Journey 11% 06/11/20-RegS	美元 7,700,000	8,054,243	0.3			-----	----
Scenery Journey 11.5% 24/10/22-RegS	美元 2,500,000	2,348,007	0.1	总上市投资		2,972,438,286	95.9
Scenery Journey 13% 06/11/22-RegS	美元 3,500,000	3,444,739	0.1	其他净资产		125,966,143	4.1
Scenery Journey 13.75% 6/11/23-RegS	美元 4,800,000	4,621,833	0.2				
Sino-Ocean Land VRN 4.9% Perp-RegS	美元 5,350,000	4,454,469	0.1	截至二零二零年九月三十日可赎回 份额持有人应占净资产		3,098,404,429	100.0
Sinopec Grp 2018 2.15% 13/5/25-RegS	美元 11,400,000	11,875,855	0.4				
Sinopec Grp 2018 2.7% 13/05/30-RegS	美元 15,900,000	16,885,005	0.5	总投资, 按成本		2,889,604,150	
Sinopec Grp 2018 3.68% 8/8/49-RegS	美元 8,500,000	9,847,401	0.3				
Spic 2018 Usd Bd VRN 5.8% Perp-RegS	美元 10,000,000	10,696,944	0.3				

投资组合持有变动表

截至二零二零年九月三十日止年度 (未经审计)

持有占资产净值百分比

	2020	2019
上市投资		
债务证券		
维京群岛	20.8	16.6
中国	12.2	7.8
开曼群岛	11.9	11.2
印度尼西亚	11.3	9.0
香港	10.4	10.8
新加坡	5.9	6.0
韩国	5.1	5.1
印度	5.0	7.2
马来西亚	2.9	2.6
菲律宾	1.7	2.0
毛里求斯	1.5	1.4
荷兰	1.3	1.6
墨西哥	1.1	-
百慕大	1.0	2.0
巴基斯坦	0.8	-
巴哈马群岛	0.5	0.5
泰国	0.5	4.1
国际	0.4	0.9
美国	0.4	3.8
英国	0.3	0.4
斯里兰卡	0.3	1.0
越南	0.3	-
卢森堡	0.2	0.3
哥伦比亚	0.0	0.6
秘鲁	-	0.9
蒙古	-	0.6
澳大利亚	-	0.5
智利	-	0.5
衍生性产品		
远期外汇合约	0.1	(0.2)
期货	(0.0)	-
总上市投资	<u>95.9</u>	<u>97.2</u>
其他净资产	<u>4.1</u>	<u>2.8</u>
截至九月三十日可赎回份额持有人应占净资产	<u><u>100.0</u></u>	<u><u>100.0</u></u>

财务状况表

截至二零二零年九月三十日

综合收益表

截至二零二零年九月三十日止年度

	2020 美元	2019 美元
资产		
银行现金	167,618,765	146,274,407
短期存款	-	5,740,235
分配应收款项	17,442,187	30,596,837
保证金	1,517,682	4,313,846
衍生性产品 [附注 4(l)(a)]	14,308,682	12,695,707
投资 [附注 4(l)(a)]	2,970,845,481	3,228,290,015
利息和其他应收款项	8,777	11,958
总资产	3,171,741,574	3,427,923,005
负债		
透支经纪款项	391,036	475,689
应付经纪款项	8,008,676	54,534,239
赎回应付款项	38,349,734	26,226,963
应付收益分配 [附注 6]	10,520,730	8,627,256
衍生性产品 [附注 4(l)(a)]	12,715,877	19,693,422
其他应付款项	3,351,092	3,880,955
总负债 (不含可赎回份额持有人 应占净资产)	73,337,145	113,438,524
可赎回份额持有人应占净资产 [附注 3]	3,098,404,429	3,314,484,481

由受托人及管理人于二零二一年一月二十五日批准

签署人:

汇丰机构信托服务 (亚洲) 有限公司, 受托人

摩根基金 (亚洲) 有限公司, 管理人

	2020 美元	2019 美元
收入		
投资及衍生性产品净收益 [附注 5]	209,323,235	155,941,064
存款利息	1,336,753	2,757,073
汇兑净亏损	(7,374,627)	(8,219,273)
其他收入 [附注 13]	717,427	53,950
	<u>204,002,788</u>	<u>150,532,814</u>
支出		
管理费用 [附注 8(e)]	31,199,004	25,825,064
交易成本	1,543,640	1,420,368
受托人费用 [附注 9]	797,965	666,179
托管费用及银行费用	731,902	655,182
基金注册登记机构费用 [附注 8(f)]	450,237	403,948
法律及专业费用	42,297	27,702
核数师酬金	34,904	28,104
估值费用 [附注 8(e)]	17,430	17,220
印刷及出版支出	14,435	12,134
其他经营费用	36,242	19,776
	<u>34,868,056</u>	<u>29,075,677</u>
净经营利润	169,134,732	121,457,137
财务成本		
收益分配 [附注 6]	(106,873,456)	(82,555,833)
利息支出	(2,896)	(545)
	<u>(106,876,352)</u>	<u>(82,556,378)</u>
除税前利润	62,258,380	38,900,759
税项 [附注 7]	(1,423,547)	(2,164,013)
可赎回份额持有人应占净资产 及总综合收益之增加	60,834,833	36,736,746

可赎回份额持有人应占净资产变动表
截至二零二零年九月三十日止年度

	2020 美元	2019 美元
年初可赎回份额持有人应占净资产	3,314,484,481	2,243,871,535
分配可赎回份额 [附注 3]	2,375,810,397	2,720,323,366
赎回可赎回份额 [附注 3]	(2,652,725,282)	(1,686,447,166)
净(赎回)/分配	(276,914,885)	1,033,876,200
	3,037,569,596	3,277,747,735
可赎回份额持有人应占净资产及 总综合收益之增加	60,834,833	36,736,746
年末可赎回份额持有人应占净资产	3,098,404,429	3,314,484,481

现金流量表
截至二零二零年九月三十日止年度

	2020 美元	2019 美元
经营业务		
购入投资及衍生性产品	(3,521,251,907)	(4,680,295,086)
出售投资及衍生性产品所得款项	3,932,903,593	3,787,630,606
保证金之减少/(增加)	2,796,164	(4,225,505)
已收利息	1,339,887	2,780,389
透支经纪款项之减少	(84,653)	(1,513,831)
已付基金注册登记机构费用	(457,226)	(362,304)
已付受托人费用	(804,315)	(638,275)
已付交易费用	(1,544,510)	(1,419,672)
已付税项	(1,756,994)	(2,196,005)
已付管理费用	(31,422,431)	(24,722,346)
其他	(7,774,562)	(7,367,439)
经营业务所产生/(运用)之 现金净额	371,943,046	(932,329,468)
融资活动		
已付利息	(2,896)	(545)
分配可赎回份额所得款项	2,388,965,047	2,753,845,134
赎回可赎回份额付款	(2,640,602,511)	(1,674,842,120)
已付收益分配	(104,979,982)	(79,826,449)
融资活动所(运用)/产生之 现金净额	(356,620,342)	999,176,020
现金及现金等价物之增加	15,322,704	66,846,552
年初现金及现金等价物	152,014,642	86,723,773
现金及现金等价物之汇兑收益 /(亏损)	281,419	(1,555,683)
年末现金及现金等价物	167,618,765	152,014,642
现金及现金等价物余额分析:		
银行现金	167,618,765	146,274,407
短期存款	-	5,740,235
	167,618,765	152,014,642

财务报表之附注

1 本基金

摩根亚洲总收益债券基金（“本基金”）根据二零零四年十一月三十日的信托契约（经修订）（“信托契约”）成立，受香港法律监管。本基金已获香港证券及期货事务监察委员会（“证监会”）认可。

投资管理人已通过特别决议将其名称由JF资产管理有限公司更改为「摩根资产管理（亚太）有限公司」，更名自二零一九年七月三十日生效。

二零二零年四月三十日之前，本基金之投资目标为通过一个主要投资于亚洲债券及其他债务证券之主动管理组合，致力提供具竞争力的总回报（包括资本增长及定息收益）。

二零二零年四月三十日之后，本基金之投资目标为通过一个主要投资（即至少为资产净值总额的70%）于亚洲债券及其他债务证券之主动管理组合，致力提供具竞争力的总回报（包括资本增长及定息收益）。

根据信托契约，管理人可决定发行不同产品类别（分别称为“类别”），虽然各类别之资产将作共同投资，但各类别可应用特定的收费结构、货币或收益分配政策。由于各类别有不同的收费结构，因此每类别应占之资产净值可能不同。

所有基金份额持有人于份额持有人会议上的权利是相同的，包括召开会议、表决或以其他方式行事的权利。

2 主要会计政策

以下为本财务报表采纳之主要会计政策。除另有注明外，该等政策与所呈列年度采纳者一致。

(a) 财务报表之编制基础

本基金之财务报表乃按照香港会计师公会颁布的香港财务报告准则编制。财务报表乃按历史成本准则编制，并就按公允价值透过损益列账的金融资产及金融负债（包括衍生金融工具）之重估而做出调整。

管理人及受托人（“管理层”）按照香港财务报告准则编制财务报表时需作出若干关键会计估算、判断和假设。

于二零一九年十月一日生效的新准则及对现有准则的修订

没有于二零一九年十月一日开始的财政年度首次生效的新准则或对现有准则的修订对本基金产生重大影响。

于二零一九年十月一日后生效且并未提早采纳之新准则、对准则之修订和解释

若干新准则、准则修订及解释在二零一九年十月一日开始的年度期间生效，但在编制此等财务报表时并未提前采纳。此等新准则、准则修订及解释预期不会对本基金的财务报表产生重大影响。

(b) 投资及衍生性产品

分类

对于投资及衍生性产品，本基金基于其管理该等金融资产的经营模式及该等金融资产的合同现金流量特点进行分类。本基金按公允价值对金融资产组合进行管理并评估业绩。本基金主要关注公允价值信息，并运用该等信息对资产业绩进行评估，从而作出相应决策。

公允价值为负数的衍生性产品合约列示为按公允价值透过损益列账的负债。

因此，本基金将所有的投资组合归类为按公允价值透过损益列账的金融资产或负债。

确认、取消确认及计量

投资及衍生性产品之买卖于交易日确认。投资及衍生性产品先以公允价值确认，其后以公允价值重新计量。投资及衍生性产品所产生之已实现及未实现收益及亏损确认于综合收益表内。当收取投资及衍生性产品现金流量的权利已终止或本基金已转移差不多所有风险和回报时，即终止确认投资及衍生性产品。

公允价值估计

公允价值指在计量日期，于一项有序交易中由市场与参与者出售一项资产而应收取或转让一项负债而应支付的价格。在活跃市场中买卖的金融资产和负债的公允价值，按最后交易价计算。当被投资公司的证券交易暂停，该投资的价值按基金管理人估计的公允价值计算。

债务证券的公允价值按包括应计利息的报价计算。

集体投资计划的投资以基于相关基金管理人决定的各基金每份额净资产价值得出的公允价值而计算，或如集体投资计划为上市或在交易所买卖，则以最后交易价计算。

未平仓期货和掉期合约是以在估值日的长短仓最后交易价估值。最后交易价与合约价格之间的差额在综合收益表确认。

未平仓期权是以在估值日的长短仓最后交易价估值。最后交易价与溢价金额/合约价格之间的差额在综合收益表确认。

信贷违约的掉期是以庄家逐日盯市制度的报价和估值变化为基础的，如有，将会入账为综合收益表中的未实现收益或亏损。

远期外汇合约是以估值日的远期利率定价。远期利率与合约利率之间的差额在综合收益表确认。

公允价值级次分层间的转拨

在公允价值级次分层之间的转拨视为于报告期间开始时已发生。

(c) 金融工具抵销

若存在法律上可行使的权利，可对已确认入账的项目进行抵销，且有意以净额方式结算，或将资产变现并同时清偿债务，则金融资产及负债可予抵销，并把净额于财务状况表内列账。

(d) 收入及支出

股息收入乃于除息日当日入账，而相应的海外预缴税则入账为支出，并在综合收益表确认。

投资利息收入乃作为投资及衍生性产品净收益/亏损的一部分，在综合收益表确认。

银行现金及短期存款利息收入乃按实际利息法在综合收益表确认。

支出乃按应计基准在综合收益表确认。

(e) 外币交易

功能及呈列货币

本基金采用美元作为其功能及呈列货币。

交易及结余

外币交易按交易日期适用之汇率折算为功能货币。

外币交易和按年终汇率换算外币资产和负债产生的汇兑盈亏在综合收益表确认。

与现金及现金等价物有关的汇兑盈亏在综合收益表内的“汇兑净收益/亏损”中呈列。与按公允价值透过损益列账的金融资产及金融负债有关的汇兑盈亏在综合收益表内的“投资及衍生性产品净收益/亏损”中呈列。

(f) **现金及现金等价物**

为了编制现金流量表，现金及现金等价物指银行现金及于存放日期起在三个月或以内到期之银行存款，扣除本基金通常作为隔夜银行借款的某些短期银行借款。

(g) **保证金**

为衍生性产品交易而存放在经纪处的保证金采用实际利率法以摊销成本列账。

(h) **应收/应付经纪款项**

应收/应付经纪款项指就年末已签订合同但尚未付款的投资和衍生性产品的应收款项，及就已购投资和衍生性产品的应付款项。

该等金额按公允价值进行初始确认，并以摊余成本进行后续计量。于每一报告日期，若信贷风险自初始确认后显著增加，本基金应按与存续期预期信用损失相当的金额，对应收经纪款项计量损失准备金。计量损失准备金需考虑的因素包括经纪出现重大财务困难、破产、进行财务重组或拖欠付款的可能性。

(i) **销售份额所得款项及赎回份额支付款项**

每份额资产净值于每个交易日计算。认购/申购或赎回份额的价格将通过参考相关交易日营业时间结束时每份额资产净值计算。这是按照信托契约的条文计算，因而可能与财务报表中的会计政策不同。

可赎回份额持有人有权选择赎回份额，此等份额在财务状况表上分类为金融负债，代表可赎回份额持有人应占净资产（或“资产净值”或“净资产”或“NAV”）。如果可赎回份额持有人行使他的赎回权，则将可赎回金额以应付账款的形式在财务状况表入账。

(j) **应付可赎回份额持有人的收益分配**

拟分配至可赎回份额持有人的收益分配应于适当授权时在综合收益表中列账。就可赎回份额的收益分配在综合收益表中列账为财务成本。

(k) **作为抵押品的投资**

如果获得抵押品的一方依照合同或惯例有权将抵押品出售或再抵押，则本基金在财务状况表中将该资产与其他资产分开列账，并将该资产确认为抵押品。如果获得抵押品的一方无权将抵押品出售或再抵押，则在财务报表附注中披露该抵押品。

3 已发行份额数目及可赎回份额持有人应占净资产（每份额）

2020

	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
年初	23,120,286.731	15,239,581.017	397,919.405	413,104,210.370	10,008,306.114
总分配	16,064,592.019	8,111,720.074	378,971.776	304,797,019.002	5,438,385.076
总赎回	(16,045,139.332)	(7,714,228.444)	(266,491.740)	(295,661,069.459)	(4,683,615.135)
年末	<u>23,139,739.418</u>	<u>15,637,072.647</u>	<u>510,399.441</u>	<u>422,240,159.913</u>	<u>10,763,076.055</u>
	澳元	加元	英镑	港元	纽元
可赎回份额持有人应占净资产	<u>200,080,050</u>	<u>136,678,850</u>	<u>4,665,897</u>	<u>3,917,117,050</u>	<u>92,667,985</u>
可赎回份额持有人应占净资产（每份额）	<u>8.65</u>	<u>8.74</u>	<u>9.14</u>	<u>9.28</u>	<u>8.61</u>
	人民币对冲类别 (累计) 份额	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	美元类别 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	PRC 人民币对冲份 额（累计） 份额
已发行份额数目:					
年初	7,498,386.140	417,317,877.377	208,910.265	51,306,924.587	455,943,516.850
总分配	273,944.590	152,391,440.568	65,239.111	66,923,555.375	335,233,595.110
总赎回	(6,655,906.050)	(166,237,410.560)	(78,454.518)	(49,300,727.347)	(603,370,504.740)
年末	<u>1,116,424.680</u>	<u>403,471,907.385</u>	<u>195,694.858</u>	<u>68,929,752.615</u>	<u>187,806,607.220</u>
	人民币	人民币	美元	美元	人民币
可赎回份额持有人应占净资产	<u>15,430,879</u>	<u>3,618,794,584</u>	<u>2,621,058</u>	<u>736,162,668</u>	<u>2,461,936,140</u>
可赎回份额持有人应占净资产（每份额）	<u>13.82</u>	<u>8.97</u>	<u>13.39</u>	<u>10.68</u>	<u>13.11</u>

2020

	PRC 人民币对冲份 额 (每月派息) 份额	PRC 美元份额 (累计) 份额	PRC 美元份额 (每月派息) 份额
已发行份额数目:			
年初	89,548,206.750	38,078,109.890	3,869,878.100
总分配	29,768,566.130	21,759,339.160	1,473,634.290
总赎回	(41,456,146.470)	(18,387,554.410)	(1,666,184.120)
年末	<u>77,860,626.410</u>	<u>41,449,894.640</u>	<u>3,677,328.270</u>
	人民币	美元	美元
可赎回份额持有人应占净 资产	<u>754,021,450</u>	<u>495,983,658</u>	<u>35,772,394</u>
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	<u>9.68</u>	<u>11.97</u>	<u>9.73</u>

2019

	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
年初	17,580,647.496	12,695,714.683	300,644.718	257,092,549.814	6,565,515.412
总分配	24,150,973.006	10,631,997.339	336,987.575	372,732,455.961	9,235,073.470
总赎回	(18,611,333.771)	(8,088,131.005)	(239,712.888)	(216,720,795.405)	(5,792,282.768)
年末	<u>23,120,286.731</u>	<u>15,239,581.017</u>	<u>397,919.405</u>	<u>413,104,210.370</u>	<u>10,008,306.114</u>
	澳元	加元	英镑	港元	纽元
可赎回份额持有人应占净 资产	<u>205,855,872</u>	<u>136,297,063</u>	<u>3,723,282</u>	<u>3,941,035,656</u>	<u>88,379,459</u>
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	<u>8.90</u>	<u>8.94</u>	<u>9.36</u>	<u>9.54</u>	<u>8.83</u>

2019

	人民币对冲类别 (累计) 份额	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	美元类别 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	PRC人民币对冲份 额(累计) 份额
已发行份额数目:					
年初	1,548,174.875	367,391,808.423	164,902.144	35,352,688.820	149,386,313.190
总分配	6,412,654.200	221,508,028.376	158,292.747	61,844,281.163	444,483,363.510
总赎回	(462,442.935)	(171,581,959.422)	(114,284.626)	(45,890,045.396)	(137,926,159.850)
年末	<u>7,498,386.140</u>	<u>417,317,877.377</u>	<u>208,910.265</u>	<u>51,306,924.587</u>	<u>455,943,516.850</u>
	人民币	人民币	美元	美元	人民币
可赎回份额持有人应占净 资产	<u>98,885,725</u>	<u>3,811,348,133</u>	<u>2,707,081</u>	<u>557,035,318</u>	<u>5,711,865,861</u>
可赎回份额持有人应占净 资产(每份额)	<u>13.19</u>	<u>9.13</u>	<u>12.96</u>	<u>10.86</u>	<u>12.53</u>
	PRC人民币对冲份 额(每月派息) 份额	PRC美元份额 (累计) 份额	PRC美元份额 (每月派息) 份额		
已发行份额数目:					
年初	64,003,808.890	46,224,922.560	2,361,982.720		
总分配	55,599,036.900	10,951,952.000	2,411,716.130		
总赎回	(30,054,639.040)	(19,098,764.670)	(903,820.750)		
年末	<u>89,548,206.750</u>	<u>38,078,109.890</u>	<u>3,869,878.100</u>		
	人民币	美元	美元		
可赎回份额持有人应占净 资产	<u>883,011,937</u>	<u>440,896,043</u>	<u>38,278,097</u>		
可赎回份额持有人应占净 资产(每份额)	<u>9.86</u>	<u>11.58</u>	<u>9.89</u>		

4 财务风险管理

(i) 财务风险因素

本基金面临各种财务风险：市场风险（包括市场价格风险、利率风险及汇兑风险）、信贷风险及流动性风险。

(a) 市场风险

(i) 市场价格风险

本基金主要投资债务证券，此等债券须承担利率风险。利率风险请参阅附注 4(l)(a)(ii)。

(ii) 利率风险

利率风险指金融工具的价值或未来现金流量因市场利率变动而波动不定的风险。本基金须承担现行市场利率水平波动对其投资、衍生性产品及现金存款造成影响的风险。

下表按剩余到期日分类，概述截至九月三十日本基金须承担现行市场利率水平波动影响风险的金融资产及负债。

	1 年以内 美元	1 至 5 年 美元	5 年以上 美元	总额 美元
2020				
银行现金	167,618,765	-	-	167,618,765
保证金	1,517,682	-	-	1,517,682
衍生型产品	(76,688)	-	-	(76,688)
投资 (注*)	144,082,610	1,302,224,761	1,524,538,110	2,970,845,481
总利率敏感性缺口	<u>313,142,369</u>	<u>1,302,224,761</u>	<u>1,524,538,110</u>	<u>3,139,905,240</u>
2019				
银行现金	146,274,407	-	-	146,274,407
短期存款	5,740,235	-	-	5,740,235
保证金	4,313,846	-	-	4,313,846
投资 (注*)	148,419,414	1,315,186,699	1,764,683,902	3,228,290,015
总利率敏感性缺口	<u>304,747,902</u>	<u>1,315,186,699</u>	<u>1,764,683,902</u>	<u>3,384,618,503</u>

注：

* 投资的票面息率范围介乎年率 0.00% - 13.75% (二零一九年：年率 0.00% - 13.50%)。

截至九月三十日，本基金投资及衍生性产品之公平值如下：

	2020		2019	
	投资之公平值 美元	占资产净值 百分比	投资之公平值 美元	占资产净值 百分比
上市投资				
资产				
债务证券				
- 维京群岛	644,286,435	20.8	549,712,342	16.6
- 中国	378,577,213	12.2	257,498,293	7.8
- 开曼群岛	370,345,123	11.9	370,415,622	11.2
- 印度尼西亚	349,240,956	11.3	296,694,323	9.0
- 香港	321,030,970	10.4	356,883,924	10.8
- 新加坡	184,402,968	5.9	199,379,626	6.0
- 韩国	157,383,430	5.1	167,666,428	5.1
- 印度	156,154,625	5.0	239,077,938	7.2
- 其他	409,423,761	13.2	790,961,519	23.7
	<u>2,970,845,481</u>	<u>95.8</u>	<u>3,228,290,015</u>	<u>97.4</u>
衍生性产品				
- 远期外汇合约	14,308,682	0.5	12,695,707	0.4
	<u>2,985,154,163</u>	<u>96.3</u>	<u>3,240,985,722</u>	<u>97.8</u>
负债				
衍生性产品				
- 远期外汇合约	(12,639,189)	(0.4)	(19,693,422)	(0.6)
- 期货	(76,688)	(0.0)	-	-
	<u>(12,715,877)</u>	<u>(0.4)</u>	<u>(19,693,422)</u>	<u>(0.6)</u>
总上市投资	<u>2,972,438,286</u>	<u>95.9</u>	<u>3,221,292,300</u>	<u>97.2</u>

有关衍生性产品合约的风险亦请参阅附注 12。

投资管理主要通过本基金的修正久定期监控本基金的利率风险敏感度。修正久期计量某项债券的价格相对于利率变动的敏感度。于二零二零年九月三十日，投资管理人估计本基金的修正久期为 4.42（二零一九年：4.19）。为了披露相关敏感度，采用的利率合理变动百分比为二十五个基点，不包括不大可能出现或“最恶劣”情况或“压力测试”下之变动，也不代表投资管理人对本基金未来回报的预测。若利率上升二十五个基点，其他变量保持稳定，则将致使本基金的资产净值减少约 34,237,369 美元（二零一九年：34,719,225 美元）。若利率下降二十五个基点，则将致使本基金的资产净值增加相同金额。

任何现金及现金等价物及保证金均以短期市场利率进行存放/借入。由于现行市场利率水平平稳且波动较低，投资管理人认为本基金不存在重大风险。

(iii) 汇兑风险

本基金持有以若干币种计价的资产及负债。香港财务报告准则第 7 号认为与非货币资产及负债相关的外汇承担属于市场价格风险，而非汇兑风险。但是，投资管理人监控所有以外币计价的资产及负债（包括货币及非货币资产及负债）的汇兑风险承担。

本基金订立了若干远期外汇合约，以对冲若干外汇承担以维持有限的非美元风险承担。年末未平仓远期外汇合约请参阅附注 12(a)。

下表概述截至九月三十日本基金的汇兑风险承担、外币合理变动百分比以及对本基金资产净值的估计影响。

汇兑风险承担净值 (注*)	美元 等值	与美元比较之合理 变动百分比 (注**)	估计对资产 净值的影响 美元
2020			
澳元	143,852,947	+6.3	9,062,736
巴西雷亚尔	28,883,071	-26.1	(7,538,482)
加元	102,512,616	-0.9	(922,614)
人民币 (离岸)	913,763,073	+5.2	47,515,680
人民币 (在岸)	173,497,894	+4.8	8,327,899
哥伦比亚比索	13,671,944	-9.8	(1,339,851)
欧元	(15,200,806)	+7.6	(1,155,261)
港元	74,833,494	+1.2	898,002
印度卢比	33,497,673	-3.9	(1,306,409)
印尼盾	80,756,185	-4.6	(3,714,785)
日元	14,887,455	+2.4	357,299
韩元	43,769,358	+2.3	1,006,695
马来西亚林吉特	55,258,876	+0.8	442,071
墨西哥新比索	49,431,268	-10.6	(5,239,714)
纽元	61,310,831	+5.4	3,310,785
秘鲁新索尔	(58)	-5.9	3
菲律宾比索	(30,051,026)	+6.9	(2,073,521)
新加坡元	684,386	+1.3	8,897
英镑	6,149,552	+4.9	301,328
台币	14,412,997	+7.1	1,023,323
越南盾	7,835,101	+0.1	7,835
	<u>1,773,756,831</u>		<u>48,971,916</u>
2019			
澳元	155,980,919	-6.8	(10,606,702)
巴西雷亚尔	15,368,343	-4.1	(630,102)
加元	103,227,923	-2.4	(2,477,470)
智利比索	16,036,450	-9.4	(1,507,426)
人民币 (离岸)	1,464,720,488	-3.7	(54,194,658)
人民币 (在岸)	42,748,943	-3.6	(1,538,962)
哥伦比亚比索	3,304,996	-14.6	(482,529)
港元	5,006,690	-0.2	(10,013)
印度卢比	(6,495,629)	+2.3	(149,399)
印尼盾	33,697,564	+5.0	1,684,878
韩元	38,123,815	-7.3	(2,783,038)
马来西亚林吉特	34,653,659	-1.2	(415,844)
墨西哥新比索	(3,304)	-5.3	175
纽元	55,549,721	-5.4	(2,999,685)
秘鲁新索尔	30,906,983	-2.5	(772,675)
菲律宾比索	17,114,942	+4.2	718,828
新加坡元	24,839,499	-1.2	(298,074)
英镑	4,686,162	-5.5	(257,739)
泰铢	56,796,336	+5.7	3,237,391
	<u>2,096,264,500</u>		<u>(73,483,044)</u>

假定影响本基金资产净值的其他变量保持不变，若外币呈反方向波动，则将导致本基金的资产净值以相同金额呈反向变动。

注：

* 资产及负债汇兑风险承担净值包括货币及非货币资产及负债。

** 合理变动百分比基于各货币于过去十二个月较本基金功能货币之实际历史变动，不包括不大可能出现或“最恶劣”情况或“压力测试”下之变动，也不代表投资管理人对本基金未来回报的预测。

(b) 信贷风险

信贷风险指交易对手无法于到期日支付全数金额的风险。

管理人会参考交易对手的违约历史及其信贷评级等因素进行信贷风险监控。由于过去 5 年内，本基金在分配应收款项或利息和其他应收款项等应收款项未发生历史违约，故管理人认为该等应收款项不存在重大信贷风险。总体而言，由于该等工具违约风险较低，且本基金交易对手均有足够能力在短期内履行其合同义务，故管理人认为违约概率近乎零。因此，未对十二个月内的预期信贷损失确认损失准备金。

截至九月三十日，在信用增级前本基金的最高信贷风险承担列示如下：

	2020 美元	2019 美元
银行现金	167,618,765	146,274,407
短期存款	-	5,740,235
分配应收款项	17,442,187	30,596,837
保证金	1,517,682	4,313,846
经纪发行的衍生性产品	14,308,682	12,695,707
投资 - 债务证券	2,970,845,481	3,228,290,015
利息和其他应收款项	8,777	11,958
	<u>3,171,741,574</u>	<u>3,427,923,005</u>

所有上市投资交易均由经核准的经纪按照货银交付原则进行结算。由于本基金的托管银行只会在收取款项后始交付有关投资，所以违约风险甚低。就购买而言，本基金的托管银行会在收到投资后即时付款。若任何一方不能履行其责任，交易将告失效。

本基金主要投资债务证券，因此，本基金须承担信贷风险，即发行机构可能无法于到期时偿还本金及利息。本基金通过参考信贷评级机构提供的信贷评级及信贷展望（如有）以及内部信贷分析，持续管理并监控债务证券之信贷风险。

下表概述截至九月三十日按照信贷评级的债务证券。

	2020 占资产净值百分比	2019 占资产净值百分比
标准普尔(AAA)/穆迪(Aaa)/惠誉(AAA)	0.5	5.5
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	1.7	0.9
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	19.4	17.1
标准普尔(BBB)/穆迪(Baa)/惠誉(BBB)	32.5	31.6
标准普尔(BB)/穆迪(Ba)/惠誉(BB)	18.0	17.0
标准普尔(B)/穆迪(B)/惠誉(B)	8.0	8.9
未评级	15.7	16.4
	<u>95.8</u>	<u>97.4</u>

截至九月三十日，按照发行机构的信贷评级，下表概述上述未评级债务证券。

	2020 占资产净值百分比	2019 占资产净值百分比
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	-	0.6
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	6.2	2.8
标准普尔(BBB)/穆迪(Baa)/惠誉(BBB)	4.8	7.7
标准普尔(BB)/穆迪(Ba)/惠誉(BB)	-	0.5
未评级	4.7	4.8
	<u>15.7</u>	<u>16.4</u>

下表概述本基金截至九月三十日存放金融资产的银行/经纪/托管的信贷评级。

	2020 交易对手风险承担 美元	2019 交易对手风险承担 美元
银行结余及短期存款		
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	5,671,317	18,125,320
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	161,947,448	133,889,322
存放经纪之保证金及经纪持有/发行的衍生性产品		
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	879,255	6,953,589
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	14,947,109	10,055,964
托管机构的投资余额		
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	-	3,228,290,015
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	2,970,845,481	-
	<u>2,970,845,481</u>	<u>3,228,290,015</u>

(c) 流动性风险

本基金须面对份额每日赎回的风险，而其大多数投资资产均在活跃市场交易，并可随时出售。管理人亦可将任何一个交易日之赎回份额总数限制为本基金已发行份额的百分之十或更高。

在投资限制和指南的规限下，本基金有能力订立借款安排。

下表概述本基金的金融负债，按九月三十日距约定到期日的尚余期间分为有关期限组别。下表所载金额乃约定未折现现金流量。

	2020		2019	
	1个月以内 美元	1至12个月 美元	1个月以内 美元	1至12个月 美元
透支经纪款项	391,036	-	475,689	-
应付经纪款项	8,008,676	-	54,534,239	-
赎回应付款项	38,349,734	-	26,226,963	-
应付收益分配	10,520,730	-	8,627,256	-
衍生性产品	6,554,157	6,161,720	8,379,924	11,313,498
其他应付款项	3,351,092	-	3,880,955	-
可赎回份额持有人应占净资产	3,098,404,429	-	3,314,484,481	-
总金融负债	<u>3,165,579,854</u>	<u>6,161,720</u>	<u>3,416,609,507</u>	<u>11,313,498</u>

投资管理通过投资于预期一般在一个月内变现到期的资产和借入短期银行借款以偿还金融负债来管理本基金的流动性风险。

(d) 受总抵销安排及类似协议规限的对销与金额

截至二零二零年及二零一九年九月三十日，本基金受制于与若干衍生品交易对手的总净额结算协议。

若发生违约，本基金及其交易对手有权按净额结算该等交易。违约事件可能包括付款或交付失败、违反协议或破产。

下表按金融工具类型概述截至九月三十日本基金受抵销和总净额结算协议及类似协议规限的金融资产及负债。

	财务状况表中列示的经确认金融资产总额 美元	受总抵销安排及类似协议规限的相关金额		净额 美元
		金融工具 美元	抵押品及保证金 美元	
<u>2020</u>				
<u>资产</u>				
保证金	1,517,682	-	(1,517,682)	-
衍生性产品	13,916,316	(4,667,817)	-	9,248,499
按公允价值透过损益列账的金融资产	<u>15,433,998</u>	<u>(4,667,817)</u>	<u>(1,517,682)</u>	<u>9,248,499</u>

	财务状况表中列示的经确认金融负债总额 美元	受总抵销安排及类似协议规限的相关金额		净额 美元
		金融工具 美元	抵押品及保证金 美元	
<u>负债</u>				
透支经纪款项	391,036	-	(391,036)	-
衍生性产品	7,349,822	(4,667,817)	(1,126,646)	(1,555,359)
按公允价值透过损益列账的金融负债	<u>7,740,858</u>	<u>(4,667,817)</u>	<u>(1,157,682)</u>	<u>(1,555,359)</u>

	财务状况表中列	受总抵销安排及类似协议规限的		净额
	示的经确认金融	相关金额		
	资产总额	金融工具	抵押品及保证金	美元
	美元	美元	美元	美元
<u>2019</u>				
<u>资产</u>				
保证金	4,313,846	-	(1,445,536)	2,868,310
衍生性产品	11,685,436	(8,251,789)	(475,689)	2,957,958
按公允价值透过损益列账的金融资产	<u>15,999,282</u>	<u>(8,251,789)</u>	<u>(1,921,225)</u>	<u>5,826,268</u>

	财务状况表中列	受总抵销安排及类似协议规限的		净额
	示的经确认金融	相关金额		
	负债总额	金融工具	抵押品及保证金	美元
	美元	美元	美元	美元
<u>负债</u>				
透支经纪款项	475,689	-	(475,689)	-
衍生性产品	15,287,964	(8,251,789)	(1,445,536)	5,590,639
按公允价值透过损益列账的金融负债	<u>15,763,653</u>	<u>(8,251,789)</u>	<u>(1,921,225)</u>	<u>5,590,639</u>

(II) 资本风险管理

本基金的资本是以可赎回份额持有人应占净资产呈示，基金的认购/申购和赎回乃由份额持有人决定。本基金以保障为份额持有人提供回报和长期资本增值为目标。

为了维持资本结构，本基金的政策执行如下：

- 监测相对于流动性资产的分配和赎回活动。
- 为了保护份额持有人在特殊情况下的利益，管理人亦可将任何一个交易日之赎回份额总数限制为本基金已发行份额的百分之十或更高。
- 按照宪制性文件，监测基金的投资指南及限制条件，以透过分散投资维持足够的资金流通性。

(III) 公允价值估计

截至二零二零年及二零一九年九月三十日，管理人认为资产及负债的账目价值与公允价值相若。

香港财务报告准则第 13 号要求本基金根据公允价值级次进行分类从而反映公允价值在计量时所使用的输入值的重要性。公允价值级次分层如下：

- 第一层次—相同资产或负债在活跃市场中的报价（未经调整）。
- 第二层次—直接（即按照价格）或间接（即源于价格）地使用除第一层次中的资产或负债的市场报价以外的其他可观察输入值。
- 第三层次—资产或负债使用了非基于可观察市场数据（即不可观察的输入值）。

下表概述本基金截至九月三十日的投资及衍生性产品（按类别）按公平值级次计量之公平值：

上市投资	第一层次 美元	第二层次 美元	第三层次 美元	总额 美元
<u>2020</u>				
<u>资产</u>				
债务证券	-	2,970,845,481	-	2,970,845,481
衍生性产品	-	14,308,682	-	14,308,682
按公平值透过损益列账的总金融资产	-	2,985,154,163	-	2,985,154,163
<u>负债</u>				
衍生性产品	76,688	12,639,189	-	12,715,877
按公平值透过损益列账的总金融负债	76,688	12,639,189	-	12,715,877
<u>2019</u>				
<u>资产</u>				
债务证券	-	3,228,290,015	-	3,228,290,015
衍生性产品	-	12,695,707	-	12,695,707
按公平值透过损益列账的总金融资产	-	3,240,985,722	-	3,240,985,722
<u>负债</u>				
衍生性产品	-	19,693,422	-	19,693,422
按公平值透过损益列账的总金融负债	-	19,693,422	-	19,693,422

由于投资价值是基于活跃市场的报价，因此分类为第一层次，并包括活跃上市股票证券及交易所交易衍生性产品。本基金没有调整这些工具的报价。

于非活跃市场交易的金融投资但以市场报价、交易商/经纪报价或其他报价来源作为可观察输入值，此等投资分类为第二层次。

被分类为第三层次的投资，由于其交易次数疏落，故此有显著的不可观察输入值。

截至二零二零年及二零一九年九月三十日止年度，公平值层次之间并无转拨。

截至二零二零年及二零一九年九月三十日，以摊余成本计量的资产和负债，其账面价值为其公平的合理约数。

5 投资及衍生性产品净收益

	2020 美元	2019 美元
投资及衍生性产品价值未实现收益/亏损之变动	27,540,509	151,041,542
投资及衍生性产品销售之实现收益	181,782,726	4,899,522
	<u>209,323,235</u>	<u>155,941,064</u>

6 收益分配

二零二零年八月三十一日之前，管理人有意就每个会计期应占收入的至少 85% 拨作收益分配类别，在分别收取每收益分配类别的费用后，分配予该等收益分配类别的份额持有人。

一旦该金额不足够支付本基金宣布之收益分配时，管理人可酌情决定从资本中拨款支付该等收益分配。

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2020 美元	2019 美元
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	澳元 0.0268	23,442,122.852	(432,832)	
加元对冲类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	加元 0.0329	15,742,362.405	(394,053)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	英镑 0.0268	366,162.865	(12,698)	
港元类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	港元 0.0387	415,807,481.174	(2,053,121)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	纽元 0.0291	10,588,479.865	(197,600)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	人民币 0.0435	421,515,916.177	(2,602,819)	
美元类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	美元 0.0440	50,606,831.446	(2,226,701)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	人民币 0.0470	90,829,498.130	(605,990)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	美元 0.0401	3,928,976.590	(157,552)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	澳元 0.0289	22,939,509.536	(448,421)	
加元对冲类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	加元 0.0354	15,522,256.213	(413,693)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	英镑 0.0294	383,656.743	(14,590)	
港元类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	港元 0.0386	427,034,239.174	(2,105,780)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	纽元 0.0308	10,659,973.708	(210,753)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	人民币 0.0445	422,314,748.468	(2,673,277)	
美元类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	美元 0.0440	53,345,028.968	(2,347,181)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	人民币 0.0480	91,959,604.780	(627,894)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	美元 0.0401	4,008,155.380	(160,727)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	澳元 0.0292	22,247,756.735	(456,661)	
加元对冲类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	加元 0.0339	15,204,514.645	(397,481)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	英镑 0.0262	382,834.915	(13,288)	
港元类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	港元 0.0384	408,102,380.680	(2,011,234)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	纽元 0.0314	10,667,041.355	(225,971)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	人民币 0.0456	422,721,567.091	(2,767,507)	
美元类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	美元 0.0440	53,382,022.125	(2,348,809)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	人民币 0.0492	90,516,377.590	(639,384)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	美元 0.0401	3,914,306.040	(156,964)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	澳元 0.0294	20,901,261.467	(411,375)	
加元对冲类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	加元 0.0346	14,721,069.863	(385,126)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	英镑 0.0283	395,425.420	(14,751)	
港元类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	港元 0.0383	403,451,258.238	(1,990,004)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月11日	纽元 0.0316	9,919,775.710	(202,859)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	人民币 0.0452	411,180,327.535	(2,653,989)	
美元类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	美元 0.0440	55,750,551.417	(2,453,024)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2020年2月3日	2020年2月11日	人民币 0.0488	86,532,175.840	(601,847)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年2月3日	2020年2月11日	美元 0.0401	3,899,616.430	(156,375)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	澳元 0.0308	20,877,039.084	(414,582)	
加元对冲类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	加元 0.0368	14,852,277.163	(407,169)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	英镑 0.0301	420,407.886	(16,163)	
港元类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	港元 0.0383	405,314,084.477	(1,991,971)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	纽元 0.0324	9,832,147.373	(197,588)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	人民币 0.0455	410,048,435.667	(2,669,052)	
美元类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	美元 0.0440	55,380,210.297	(2,436,729)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	人民币 0.0491	87,120,529.080	(611,945)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	美元 0.0401	3,923,101.970	(157,316)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	澳元 0.0334	20,740,149.608	(423,980)	
加元对冲类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	加元 0.0355	14,492,545.157	(361,461)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	英镑 0.0302	352,428.430	(13,197)	
港元类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	港元 0.0383	360,895,423.773	(1,783,315)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	纽元 0.0365	9,504,003.386	(205,657)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	人民币 0.0430	374,722,559.945	(2,273,225)	
美元类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	美元 0.0440	50,053,030.584	(2,202,333)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	人民币 0.0464	75,025,476.730	(491,124)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	美元 0.0401	3,360,061.090	(134,738)	

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2020 美元	2019 美元
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年4月29日	2020年5月11日	澳元 0.0343	20,509,681.003	(459,761)	
加元对冲类别 (每月派息)	2020年4月29日	2020年5月11日	加元 0.0333	14,678,993.567	(350,943)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2020年4月29日	2020年5月11日	英镑 0.0338	351,806.498	(14,788)	
港元类别 (每月派息)	2020年4月29日	2020年5月11日	港元 0.0382	354,980,740.200	(1,749,587)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年4月29日	2020年5月11日	纽元 0.0376	9,145,788.980	(210,009)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2020年4月29日	2020年5月11日	人民币 0.0375	371,732,734.622	(1,969,062)	
美元类别 (每月派息)	2020年4月29日	2020年5月11日	美元 0.0440	49,293,229.644	(2,168,902)	
PRC人民币对冲份额 (每月派息)	2020年4月29日	2020年5月11日	人民币 0.0405	76,651,505.610	(438,504)	
PRC美元份额 (每月派息)	2020年4月29日	2020年5月11日	美元 0.0401	3,365,672.400	(134,963)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年5月29日	2020年6月9日	澳元 0.0348	21,071,369.399	(486,754)	
加元对冲类别 (每月派息)	2020年5月29日	2020年6月9日	加元 0.0356	14,648,890.831	(377,297)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2020年5月29日	2020年6月8日	英镑 0.0365	356,782.665	(16,100)	
港元类别 (每月派息)	2020年5月29日	2020年6月8日	港元 0.0382	354,344,996.678	(1,746,353)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年5月29日	2020年6月8日	纽元 0.0371	9,137,231.668	(209,920)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2020年5月29日	2020年6月8日	人民币 0.0459	372,728,407.214	(2,388,017)	
美元类别 (每月派息)	2020年5月29日	2020年6月8日	美元 0.0440	51,681,256.528	(2,273,975)	
PRC人民币对冲份额 (每月派息)	2020年5月29日	2020年6月8日	人民币 0.0496	76,628,555.100	(530,523)	
PRC美元份额 (每月派息)	2020年5月29日	2020年6月8日	美元 0.0401	3,417,616.110	(137,046)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年6月30日	2020年7月9日	澳元 0.0353	22,139,220.413	(538,073)	
加元对冲类别 (每月派息)	2020年6月30日	2020年7月9日	加元 0.0357	14,950,196.237	(391,866)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2020年6月30日	2020年7月9日	英镑 0.0363	373,978.518	(16,774)	
港元类别 (每月派息)	2020年6月30日	2020年7月9日	港元 0.0382	360,552,540.709	(1,777,072)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年6月30日	2020年7月9日	纽元 0.0368	9,018,733.424	(213,654)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2020年6月30日	2020年7月9日	人民币 0.0524	371,927,245.380	(2,757,453)	
美元类别 (每月派息)	2020年6月30日	2020年7月9日	美元 0.0440	55,679,479.903	(2,449,897)	
PRC人民币对冲份额 (每月派息)	2020年6月30日	2020年7月9日	人民币 0.0566	74,745,311.800	(598,576)	
PRC美元份额 (每月派息)	2020年6月30日	2020年7月9日	美元 0.0401	3,536,790.040	(141,825)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年7月31日	2020年8月10日	澳元 0.0345	23,070,971.328	(570,815)	
加元对冲类别 (每月派息)	2020年7月31日	2020年8月10日	加元 0.0351	14,516,586.724	(380,390)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2020年7月31日	2020年8月10日	英镑 0.0359	404,839.674	(19,076)	
港元类别 (每月派息)	2020年7月31日	2020年8月10日	港元 0.0382	375,555,838.884	(1,851,079)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年7月31日	2020年8月10日	纽元 0.0356	9,160,825.010	(217,248)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2020年7月31日	2020年8月10日	人民币 0.0521	376,333,279.141	(2,810,128)	
美元类别 (每月派息)	2020年7月31日	2020年8月10日	美元 0.0440	62,882,422.327	(2,766,827)	
PRC人民币对冲份额 (每月派息)	2020年7月31日	2020年8月10日	人民币 0.0564	70,977,108.590	(573,737)	
PRC美元份额 (每月派息)	2020年7月31日	2020年8月10日	美元 0.0401	3,551,302.640	(142,407)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年8月31日	2020年9月8日	澳元 0.0344	23,681,995.364	(602,482)	
加元对冲类别 (每月派息)	2020年8月31日	2020年9月8日	加元 0.0353	15,034,677.504	(407,325)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2020年8月31日	2020年9月8日	英镑 0.0363	468,597.172	(22,776)	
港元类别 (每月派息)	2020年8月31日	2020年9月8日	港元 0.0382	391,191,800.697	(1,928,160)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年8月31日	2020年9月8日	纽元 0.0357	10,362,845.488	(250,052)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2020年8月31日	2020年9月8日	人民币 0.0559	387,553,591.942	(3,163,056)	
美元类别 (每月派息)	2020年8月31日	2020年9月8日	美元 0.0440	65,985,545.167	(2,903,364)	
PRC人民币对冲份额 (每月派息)	2020年8月31日	2020年9月8日	人民币 0.0603	77,889,388.150	(685,739)	
PRC美元份额 (每月派息)	2020年8月31日	2020年9月8日	美元 0.0401	3,653,233.210	(146,495)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年9月30日	2020年10月12日	澳元 0.0344	23,092,224.753	(569,366)	
加元对冲类别 (每月派息)	2020年9月30日	2020年10月13日	加元 0.0353	15,745,512.214	(416,108)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2020年9月30日	2020年10月12日	英镑 0.0357	510,399.441	(23,556)	
港元类别 (每月派息)	2020年9月30日	2020年10月12日	港元 0.0382	422,002,482.359	(2,080,064)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年9月30日	2020年10月12日	纽元 0.0361	10,762,145.751	(256,807)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2020年9月30日	2020年10月12日	人民币 0.0556	402,801,067.949	(3,300,140)	
美元类别 (每月派息)	2020年9月30日	2020年10月13日	美元 0.0440	69,028,558.583	(3,037,257)	
PRC人民币对冲份额 (每月派息)	2020年9月30日	2020年10月12日	人民币 0.0601	77,959,972.350	(690,420)	
PRC美元份额 (每月派息)	2020年9月30日	2020年10月13日	美元 0.0400	3,675,296.850	(147,012)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2018年10月31日	2018年11月8日	澳元 0.0288	16,889,031.696		(344,739)
加元对冲类别 (每月派息)	2018年10月31日	2018年11月8日	加元 0.0252	12,483,470.662		(239,546)
英镑对冲类别 (每月派息)	2018年10月31日	2018年11月8日	英镑 0.0197	292,080.964		(7,352)
港元类别 (每月派息)	2018年10月31日	2018年11月8日	港元 0.0329	249,725,510.368		(1,048,035)
纽元对冲类别 (每月派息)	2018年10月31日	2018年11月8日	纽元 0.0286	6,653,163.099		(124,253)
人民币对冲类别 (每月派息)	2018年10月31日	2018年11月8日	人民币 0.0477	353,104,838.596		(2,414,885)
美元类别 (每月派息)	2018年10月31日	2018年11月8日	美元 0.0375	35,569,006.304		(1,333,838)
PRC人民币对冲份额 (每月派息)	2018年10月31日	2018年11月8日	人民币 0.0515	60,478,149.270		(446,560)
PRC美元份额 (每月派息)	2018年10月31日	2018年11月8日	美元 0.0342	2,321,306.350		(79,389)

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2020 美元	2019 美元
澳元对冲类别 (每月派息)	2018年11月30日	2018年12月10日	澳元 0.0276	16,130,569.003		(325,110)
加元对冲类别 (每月派息)	2018年11月30日	2018年12月10日	加元 0.0263	12,404,668.779		(245,461)
英镑对冲类别 (每月派息)	2018年11月30日	2018年12月10日	英镑 0.0206	333,505.573		(8,766)
港元类别 (每月派息)	2018年11月30日	2018年12月10日	港元 0.0329	241,329,106.744		(1,014,564)
纽元对冲类别 (每月派息)	2018年11月30日	2018年12月10日	纽元 0.0276	6,518,104.854		(123,573)
人民币对冲类别 (每月派息)	2018年11月30日	2018年12月10日	人民币 0.0402	346,752,378.394		(2,003,989)
美元类别 (每月派息)	2018年11月30日	2018年12月10日	美元 0.0375	34,767,451.891		(1,303,779)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2018年11月30日	2018年12月10日	人民币 0.0434	60,256,379.640		(375,961)
PRC 美元份额 (每月派息)	2018年11月30日	2018年12月10日	美元 0.0342	2,255,471.140		(77,137)
澳元对冲类别 (每月派息)	2018年12月31日	2019年1月9日	澳元 0.0264	16,343,174.862		(303,748)
加元对冲类别 (每月派息)	2018年12月31日	2019年1月9日	加元 0.0240	12,124,130.331		(213,047)
英镑对冲类别 (每月派息)	2018年12月31日	2019年1月9日	英镑 0.0160	333,601.914		(6,798)
港元类别 (每月派息)	2018年12月31日	2019年1月9日	港元 0.0329	236,696,065.084		(994,629)
纽元对冲类别 (每月派息)	2018年12月31日	2019年1月9日	纽元 0.0267	6,248,544.125		(111,872)
人民币对冲类别 (每月派息)	2018年12月31日	2019年1月9日	人民币 0.0368	343,758,311.657		(1,841,290)
美元类别 (每月派息)	2018年12月31日	2019年1月9日	美元 0.0375	34,614,870.306		(1,298,058)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2018年12月28日	2019年1月9日	人民币 0.0397	60,367,293.190		(348,118)
PRC 美元份额 (每月派息)	2018年12月28日	2019年1月9日	美元 0.0342	2,256,633.970		(77,177)
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年1月31日	2019年2月13日	澳元 0.0294	18,084,609.193		(387,680)
加元对冲类别 (每月派息)	2019年1月31日	2019年2月13日	加元 0.0266	13,656,780.922		(276,609)
英镑对冲类别 (每月派息)	2019年1月31日	2019年2月13日	英镑 0.0207	336,405.861		(9,160)
港元类别 (每月派息)	2019年1月31日	2019年2月13日	港元 0.0360	252,730,751.965		(1,159,507)
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年1月31日	2019年2月13日	纽元 0.0283	7,873,544.756		(154,549)
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年1月31日	2019年2月13日	人民币 0.0364	352,009,002.308		(1,910,184)
美元类别 (每月派息)	2019年1月31日	2019年2月13日	美元 0.0410	32,707,081.125		(1,340,990)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2019年1月31日	2019年2月13日	人民币 0.0393	57,921,452.990		(339,353)
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年1月31日	2019年2月13日	美元 0.0374	2,175,734.200		(81,372)
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年2月28日	2019年3月8日	澳元 0.0296	18,435,959.736		(388,241)
加元对冲类别 (每月派息)	2019年2月28日	2019年3月8日	加元 0.0279	13,399,614.654		(283,864)
英镑对冲类别 (每月派息)	2019年2月28日	2019年3月8日	英镑 0.0221	399,423.502		(11,741)
港元类别 (每月派息)	2019年2月28日	2019年3月8日	港元 0.0361	265,048,758.313		(1,218,919)
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年2月28日	2019年3月8日	纽元 0.0282	8,312,173.170		(159,746)
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年2月28日	2019年3月8日	人民币 0.0307	358,643,391.281		(1,644,514)
美元类别 (每月派息)	2019年2月28日	2019年3月8日	美元 0.0410	36,296,804.387		(1,488,169)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2019年2月28日	2019年3月8日	人民币 0.0332	57,914,818.080		(287,187)
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年2月28日	2019年3月8日	美元 0.0373	2,122,205.210		(79,158)
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	澳元 0.0294	18,590,791.725		(388,255)
加元对冲类别 (每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	加元 0.0272	14,709,595.221		(299,488)
英镑对冲类别 (每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	英镑 0.0209	386,848.898		(10,535)
港元类别 (每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	港元 0.0361	295,925,507.373		(1,360,889)
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	纽元 0.0284	8,160,355.325		(158,056)
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	人民币 0.0337	378,955,848.238		(1,900,236)
美元类别 (每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	美元 0.0410	40,462,587.596		(1,658,966)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	人民币 0.0364	74,988,043.400		(406,146)
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	美元 0.0374	3,063,229.310		(114,565)
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年4月30日	2019年5月9日	澳元 0.0304	21,632,986.140		(446,882)
加元对冲类别 (每月派息)	2019年4月30日	2019年5月9日	加元 0.0295	14,755,279.359		(323,581)
英镑对冲类别 (每月派息)	2019年4月30日	2019年5月9日	英镑 0.0232	397,769.156		(12,030)
港元类别 (每月派息)	2019年4月30日	2019年5月9日	港元 0.0387	333,417,206.540		(1,644,689)
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年4月30日	2019年5月9日	纽元 0.0310	8,215,097.799		(169,838)
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年4月30日	2019年5月9日	人民币 0.0370	397,291,952.276		(2,180,575)
美元类别 (每月派息)	2019年4月30日	2019年5月9日	美元 0.0440	43,967,550.930		(1,934,572)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2019年4月30日	2019年5月9日	人民币 0.0399	87,530,324.630		(518,073)
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年4月30日	2019年5月9日	美元 0.0401	3,977,704.090		(159,506)
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年5月31日	2019年6月11日	澳元 0.0297	22,083,342.702		(454,423)
加元对冲类别 (每月派息)	2019年5月31日	2019年6月11日	加元 0.0295	14,908,632.710		(325,323)
英镑对冲类别 (每月派息)	2019年5月31日	2019年6月11日	英镑 0.0230	344,119.981		(9,976)
港元类别 (每月派息)	2019年5月31日	2019年6月11日	港元 0.0387	356,394,932.373		(1,759,122)
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年5月31日	2019年6月11日	纽元 0.0301	8,956,757.114		(175,738)
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年5月31日	2019年6月11日	人民币 0.0384	412,569,399.958		(2,285,060)
美元类别 (每月派息)	2019年5月31日	2019年6月11日	美元 0.0440	46,858,134.984		(2,061,758)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2019年5月31日	2019年6月11日	人民币 0.0415	86,562,875.240		(518,142)
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年5月31日	2019年6月11日	美元 0.0401	3,869,387.310		(155,162)

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2020 美元	2019 美元
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年6月28日	2019年7月9日	澳元0.0285	22,616,626.825		(452,330)
加元对冲类别 (每月派息)	2019年6月28日	2019年7月9日	加元0.0296	15,065,832.364		(341,265)
英镑对冲类别 (每月派息)	2019年6月28日	2019年7月9日	英镑0.0237	355,679.295		(10,728)
港元类别 (每月派息)	2019年6月28日	2019年7月9日	港元0.0386	383,919,558.812		(1,896,870)
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年6月28日	2019年7月9日	纽元0.0304	9,236,214.876		(188,587)
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年6月28日	2019年7月9日	人民币0.0398	422,589,511.182		(2,447,121)
美元类别 (每月派息)	2019年6月28日	2019年7月9日	美元0.0440	48,007,926.745		(2,112,349)
PRC人民币对冲份额 (每月派息)	2019年6月28日	2019年7月9日	人民币0.0429	86,605,119.740		(540,573)
PRC美元份额 (每月派息)	2019年6月28日	2019年7月9日	美元0.0401	3,876,990.750		(155,467)
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年7月31日	2019年8月8日	澳元0.0265	23,425,438.979		(427,869)
加元对冲类别 (每月派息)	2019年7月31日	2019年8月8日	加元0.0298	15,220,537.807		(345,408)
英镑对冲类别 (每月派息)	2019年7月31日	2019年8月8日	英镑0.0232	394,614.655		(11,210)
港元类别 (每月派息)	2019年7月31日	2019年8月8日	港元0.0385	396,296,669.801		(1,949,188)
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年7月31日	2019年8月8日	纽元0.0298	10,320,494.658		(202,983)
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年7月31日	2019年8月8日	人民币0.0366	420,135,949.653		(2,231,328)
美元类别 (每月派息)	2019年7月31日	2019年8月8日	美元0.0440	50,858,857.243		(2,237,790)
PRC人民币对冲份额 (每月派息)	2019年7月31日	2019年8月8日	人民币0.0396	86,534,569.010		(497,253)
PRC美元份额 (每月派息)	2019年7月31日	2019年8月8日	美元0.0401	3,869,288.150		(155,158)
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	澳元0.0266	22,833,387.401		(409,212)
加元对冲类别 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	加元0.0310	15,277,414.370		(356,412)
英镑对冲类别 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	英镑0.0244	389,022.597		(11,560)
港元类别 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	港元0.0387	413,767,090.767		(2,043,659)
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	纽元0.0287	9,582,626.904		(173,456)
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	人民币0.0419	422,433,254.009		(2,473,097)
美元类别 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	美元0.0440	49,314,230.558		(2,169,827)
PRC人民币对冲份额 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	人民币0.0452	87,599,260.880		(553,233)
PRC美元份额 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	美元0.0401	3,853,332.630		(154,519)
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	澳元0.0273	23,113,196.253		(425,571)
加元对冲类别 (每月派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	加元0.0318	15,272,642.206		(366,820)
英镑对冲类别 (每月派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	英镑0.0254	397,919.405		(12,455)
港元类别 (每月派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	港元0.0386	412,695,392.568		(2,032,049)
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	纽元0.0282	9,998,300.635		(176,798)
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	人民币0.0447	417,381,906.329		(2,612,582)
美元类别 (每月派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	美元0.0440	50,893,109.617		(2,239,297)
PRC人民币对冲份额 (每月派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	人民币0.0484	89,496,073.470		(606,566)
PRC美元份额 (每月派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	美元0.0401	3,868,269.210		(155,118)
可赎回份额持有人之总收益分配					(106,873,456)	(82,555,833)

7 税项

截至二零二零年及二零一九年九月三十日止年度，已就若干收取的利息收入和所得的资本收益预扣或缴付海外税项。

中国税项

本基金持有若干中国证券之投资。根据中华人民共和国税法，海外投资者从中国获得的股息和利息应缴付百分之十的企业所得税，但政府债券利息根据规定获豁免缴纳所得税，而海外机构投资者于二零一八年十一月七日至二零二一年十一月六日期间从中国本地债券市场中买卖债券所得的债券利息亦暂时获豁免缴纳所得税。在中国支付相关款项的单位有责任在支付该等款项时预扣此税项。若源自中国的股息和利息未获得特别税项豁免且支付单位未预扣税项，则全额计提百分之十的中国税项拨备。

根据中华人民共和国税法，海外投资者出售中国证券交易所实现的收益通常需缴纳百分之十的企业所得税。但目前，出售中国 A 股（包括在沪港通/深港通机制下买卖的股份）所得收益获暂时豁免缴纳企业所得税。若出售部分中国证券交易所收益目前未经明确规定获豁免缴纳企业所得税，则全额计提百分之十的中国税项拨备。

香港税项

由于本基金根据香港证券及期货条例第 104 条获认可为集体投资计划，根据香港税务条例第 26A(1A)条，本基金获豁免缴纳香港利得税，因此并无税项拨备。

8 与受托人及其关联人以及管理人及其关联人士之交易

以下是本基金与受托人及其关联人以及管理人及其关联人士之间于年度内订立的重大关联方交易摘要。基金的关联人士是根据香港证券及期货事务监察委员会所颁布的单位信托及互惠基金守则（“证监会守则”）中的定义。所有该等交易均于正常业务过程中按一般商业条款订立。

(a) 以下为与管理人及其关联人士之投资交易：

于本年度内，管理人及其关联人士之间无投资交易（二零一九年：无）。

(b) 与管理人及其关联人士之年末结余：

	2020 美元	2019 美元
银行现金	5,671,317	8,537,062
应收款项	5,139	7,890
应付款项	(2,712,327)	(2,934,456)
	<u> </u>	<u> </u>

于本年度内，存放于管理人关联人士的银行现金的利息收入为 83,423 美元（二零一九年：177,986 美元）。

(c) 本基金可能利用受托人及其关联人以及管理人及其关联人士的券商、托管人、代理人及银行服务。本基金可能收取存款利息，并为该等服务支付利息费用、交易成本、托管费用及银行费用。所有该等交易均于正常业务过程中按一般商业条款订立。

(d) 于本年度内，扣除支付给代理机构的佣金后，管理人取得本基金销售及赎回收益为 6,854 美元（二零一九年：4,887 美元）。

(e) 支付给摩根基金（亚洲）有限公司之管理费按本基金资产净值的年率百分之一计算。此管理费于每个交易日累计，并于每月月底支付。

此外，如果本基金的资产净值超过 500 万美元但低于 2,000 万美元，则管理人就每次评估收取估值费用 40 美元；如果本基金的资产净值超过 2,000 万美元，则管理人就每次评估收取估值费用 70 美元。

(f) 本基金允许管理人及其关联人士认购/申购及赎回本基金份额。所有交易均为按一般商业条款下进行的正常业务流程。

(g) 有关支付给受托人的费用，请参阅附注 9。

(h) 摩根基金（亚洲）有限公司，即登记代理人及经理人，根据本基金份额持有人的数量及发生交易的数量收取注册费。与受托人商定的收费比率为本基金资产净值的年率介乎百分之零二零一五至百分之零二零五不等。基金注册登记机构费用于每季季末支付。

9 受托人费用

受托人费用按本基金资产净值的首 4,000 万美元，以本基金资产净值的年率百分之零点点零六计算；资产净值介乎 4,000 万美元至 7,000 万美元，按年率百分之零点点零四计算；超过 7,000 万美元时，按年率百分之零点点零二五计算。受托人费用于每个交易日累计，并于每月月底支付。

10 借款

截至二零二零年及二零一九年九月三十日止年度，本基金从不同的金融机构借入无抵押短期借款，香港上海汇丰银行有限公司（受托人的关联人）为其中之一。所有银行借款的久期均在 7 天内。所有交易均为按一般商业条款下进行的正常业务流程。

11 非金钱收益／佣金共享安排

投资管理人与经纪签署了非金钱收益／佣金共享安排，从而收取若干产品和服务以协助作出投资决策。由基金支付的部分交易佣金会由经纪保留，作为产品和服务的补偿。

该等产品和服务必须对本基金具有明显的利益，并仅限于研究和咨询服务。

12 衍生性产品

(a) 以下为截至九月三十日未平仓之远期外汇合约：

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益／ (亏损) 美元
<u>2020</u>			
未平仓合约：			
美元 638,133	澳元 909,225	2020 年 10 月 2 日	13,599
美元 3,343	澳元 4,697	2020 年 10 月 2 日	23
美元 1,107	纽约元 1,681	2020 年 10 月 5 日	5
美元 1,099	加元 1,473	2020 年 10 月 5 日	4
美元 644,358	澳元 918,243	2020 年 10 月 6 日	13,838
美元 54,111	澳元 76,730	2020 年 10 月 6 日	890
美元 58,463	加元 78,303	2020 年 10 月 6 日	160
美元 1,108	澳元 1,545	2020 年 10 月 6 日	0
加元 167,424	美元 125,361	2020 年 10 月 7 日	16
纽约元 8,067	美元 5,333	2020 年 10 月 7 日	1
美元 117,073	澳元 164,534	2020 年 10 月 7 日	865
美元 12,810	纽约元 19,466	2020 年 10 月 7 日	56
美元 7,242	加元 9,710	2020 年 10 月 7 日	28
美元 14,846	澳元 20,717	2020 年 10 月 8 日	4
美元 2,942,163	离岸人民币 20,078,957	2020 年 10 月 9 日	16,585
美元 823,272	离岸人民币 5,632,912	2020 年 10 月 9 日	6,769
美元 53,108	离岸人民币 363,370	2020 年 10 月 9 日	437
美元 15,310	离岸人民币 104,754	2020 年 10 月 9 日	126
美元 1,715,961	离岸人民币 11,711,649	2020 年 10 月 13 日	9,817
美元 45,806	离岸人民币 312,633	2020 年 10 月 13 日	262
美元 306,737	离岸人民币 2,082,609	2020 年 10 月 14 日	125
美元 143,354	离岸人民币 973,310	2020 年 10 月 14 日	58
澳元 2,233,440	美元 1,648,443	2020 年 10 月 21 日	47,513
澳元 2,105,150	美元 1,531,979	2020 年 10 月 21 日	23,008
澳元 747,552	美元 543,605	2020 年 10 月 21 日	7,760
澳元 296,236	美元 219,077	2020 年 10 月 21 日	6,735
澳元 346,790	美元 254,288	2020 年 10 月 21 日	5,709
澳元 428,854	美元 312,940	2020 年 10 月 21 日	5,538
澳元 334,755	美元 243,869	2020 年 10 月 21 日	3,916
澳元 306,183	美元 223,327	2020 年 10 月 21 日	3,855

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
澳元 318,457	美元 231,857	2020年10月21日	3,587
澳元 263,587	美元 192,239	2020年10月21日	3,300
澳元 210,156	美元 153,915	2020年10月21日	3,275
澳元 785,243	美元 565,794	2020年10月21日	2,932
澳元 3,299,266	美元 2,367,837	2020年10月21日	2,923
澳元 204,821	美元 149,670	2020年10月21日	2,854
澳元 279,556	美元 202,582	2020年10月21日	2,196
澳元 310,992	美元 225,049	2020年10月21日	2,130
澳元 74,159	美元 54,167	2020年10月21日	1,009
澳元 75,557	美元 55,112	2020年10月21日	953
澳元 25,045	美元 18,252	2020年10月21日	299
澳元 2,674	美元 1,958	2020年10月21日	40
澳元 1,487	美元 1,101	2020年10月21日	35
澳元 1,506	美元 1,105	2020年10月21日	25
澳元 1,502	美元 1,096	2020年10月21日	19
澳元 1,500	美元 1,093	2020年10月21日	18
澳元 1,508	美元 1,093	2020年10月21日	12
澳元 1,506	美元 1,085	2020年10月21日	6
澳元 1,526	美元 1,095	2020年10月21日	1
加元 939,085	美元 719,038	2020年10月21日	15,972
加元 761,118	美元 579,872	2020年10月21日	10,045
加元 433,519	美元 331,447	2020年10月21日	6,884
加元 567,910	美元 430,735	2020年10月21日	5,557
加元 288,691	美元 221,082	2020年10月21日	4,947
加元 368,379	美元 278,826	2020年10月21日	3,031
加元 134,315	美元 103,091	2020年10月21日	2,533
加元 221,200	美元 168,002	2020年10月21日	2,396
加元 170,281	美元 129,355	2020年10月21日	1,870
加元 98,614	美元 75,585	2020年10月21日	1,755
加元 681,055	美元 510,854	2020年10月21日	968
加元 51,155	美元 38,838	2020年10月21日	540
加元 18,543	美元 14,078	2020年10月21日	195
加元 5,108	美元 3,878	2020年10月21日	53
加元 3,960	美元 3,006	2020年10月21日	41
加元 4,044	美元 3,068	2020年10月21日	41
加元 2,904	美元 2,215	2020年10月21日	40
加元 2,269	美元 1,728	2020年10月21日	30
加元 1,435	美元 1,099	2020年10月21日	24
加元 1,444	美元 1,101	2020年10月21日	20
加元 1,844	美元 1,397	2020年10月21日	17
加元 1,451	美元 1,101	2020年10月21日	15
加元 1,453	美元 1,103	2020年10月21日	15
加元 1,444	美元 1,095	2020年10月21日	13
加元 1,449	美元 1,097	2020年10月21日	12
加元 3,768	美元 2,833	2020年10月21日	12
离岸人民币 5,569,335	美元 821,763	2020年10月21日	1,573
离岸人民币 1,681,979	美元 248,414	2020年10月21日	711
离岸人民币 2,134,608	美元 314,964	2020年10月21日	603
离岸人民币 3,353,693	美元 494,463	2020年10月21日	569
离岸人民币 1,235,647	美元 182,495	2020年10月21日	521
离岸人民币 1,142,139	美元 168,395	2020年10月21日	194
离岸人民币 543,619	美元 80,212	2020年10月21日	154
离岸人民币 288,374	美元 42,591	2020年10月21日	122
离岸人民币 297,298	美元 43,833	2020年10月21日	50
离岸人民币 11,310	美元 1,670	2020年10月21日	5

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
离岸人民币 7,458	美元 1,101	2020年10月21日	3
离岸人民币 7,458	美元 1,101	2020年10月21日	3
离岸人民币 7,433	美元 1,097	2020年10月21日	2
离岸人民币 7,433	美元 1,097	2020年10月21日	2
离岸人民币 7,440	美元 1,097	2020年10月21日	1
英镑 48,802	美元 64,927	2020年10月21日	1,831
英镑 7,160	美元 9,633	2020年10月21日	375
英镑 8,660	美元 11,522	2020年10月21日	326
英镑 10,548	美元 13,739	2020年10月21日	102
英镑 818	美元 1,088	2020年10月21日	31
英镑 827	美元 1,098	2020年10月21日	29
英镑 833	美元 1,098	2020年10月21日	21
英镑 856	美元 1,113	2020年10月21日	7
英镑 845	美元 1,098	2020年10月21日	6
英镑 922	美元 1,194	2020年10月21日	2
纽元 451,340	美元 305,131	2020年10月21日	6,796
纽元 651,342	美元 437,146	2020年10月21日	6,610
纽元 203,529	美元 137,442	2020年10月21日	2,910
纽元 312,601	美元 208,560	2020年10月21日	1,930
纽元 115,372	美元 78,054	2020年10月21日	1,793
纽元 243,206	美元 162,327	2020年10月21日	1,568
纽元 81,995	美元 55,495	2020年10月21日	1,296
纽元 136,805	美元 91,469	2020年10月21日	1,041
纽元 108,498	美元 72,074	2020年10月21日	357
纽元 16,307	美元 11,048	2020年10月21日	269
纽元 4,056	美元 2,729	2020年10月21日	48
纽元 3,200	美元 2,143	2020年10月21日	28
纽元 2,398	美元 1,610	2020年10月21日	24
纽元 1,626	美元 1,098	2020年10月21日	23
纽元 1,639	美元 1,106	2020年10月21日	23
纽元 1,629	美元 1,095	2020年10月21日	18
纽元 1,639	美元 1,100	2020年10月21日	17
纽元 1,649	美元 1,106	2020年10月21日	17
纽元 5,440	美元 3,612	2020年10月21日	16
纽元 1,765	美元 1,178	2020年10月21日	11
纽元 1,624	美元 1,081	2020年10月21日	7
纽元 1,652	美元 1,098	2020年10月21日	5
美元 515,189,067	离岸人民币 3,528,735,994	2020年10月21日	4,486,639
美元 424,776,111	离岸人民币 2,909,461,496	2020年10月21日	3,699,257
美元 111,798,463	离岸人民币 765,752,389	2020年10月21日	973,623
美元 2,150,757	离岸人民币 14,731,394	2020年10月21日	18,731
美元 1,474,106	离岸人民币 10,115,227	2020年10月21日	15,562
美元 1,746,161	离岸人民币 11,961,911	2020年10月21日	15,467
美元 1,627,523	离岸人民币 11,155,788	2020年10月21日	15,386
美元 1,583,202	离岸人民币 10,849,299	2020年10月21日	14,571
美元 644,971	澳元 918,243	2020年10月21日	13,225
美元 1,023,663	离岸人民币 7,030,403	2020年10月21日	11,703
美元 1,023,091	离岸人民币 7,023,174	2020年10月21日	11,211
美元 894,535	离岸人民币 6,130,897	2020年10月21日	8,360
美元 881,167	离岸人民币 6,039,918	2020年10月21日	8,330
美元 871,851	离岸人民币 5,973,811	2020年10月21日	7,909
美元 1,300,914	纽元 1,979,250	2020年10月21日	7,371
美元 699,257	离岸人民币 4,790,231	2020年10月21日	6,199
美元 538,097	离岸人民币 3,695,593	2020年10月21日	6,152
美元 713,267	离岸人民币 4,884,690	2020年10月21日	6,100

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
美元 563,196	离岸人民币 3,864,616	2020年10月21日	5,945
美元 643,053	离岸人民币 4,404,604	2020年10月21日	5,612
美元 1,368,884	离岸人民币 9,332,123	2020年10月21日	5,450
美元 615,145	离岸人民币 4,213,226	2020年10月21日	5,336
美元 454,926	离岸人民币 3,117,500	2020年10月21日	4,187
美元 732,408	离岸人民币 5,001,482	2020年10月21日	4,157
美元 830,892	离岸人民币 5,669,719	2020年10月21日	4,084
美元 457,275	离岸人民币 3,132,541	2020年10月21日	4,054
美元 245,278	澳元 347,799	2020年10月21日	4,024
美元 413,575	离岸人民币 2,834,127	2020年10月21日	3,806
美元 281,038	离岸人民币 1,931,201	2020年10月21日	3,370
美元 367,854	澳元 517,618	2020年10月21日	3,174
美元 362,385	离岸人民币 2,482,033	2020年10月21日	3,143
美元 244,352	离岸人民币 1,679,108	2020年10月21日	2,930
美元 373,800	澳元 525,336	2020年10月21日	2,761
美元 214,886	离岸人民币 1,475,233	2020年10月21日	2,371
美元 260,204	离岸人民币 1,782,689	2020年10月21日	2,332
美元 249,804	离岸人民币 1,711,257	2020年10月21日	2,213
美元 232,734	离岸人民币 1,594,486	2020年10月21日	2,086
美元 570,472	英镑 442,747	2020年10月21日	1,955
美元 204,438	离岸人民币 1,400,781	2020年10月21日	1,855
美元 193,782	离岸人民币 1,327,312	2020年10月21日	1,691
美元 237,377	离岸人民币 1,621,589	2020年10月21日	1,433
美元 114,965	离岸人民币 790,000	2020年10月21日	1,379
美元 310,607	纽元 471,980	2020年10月21日	1,372
美元 235,766	离岸人民币 1,610,000	2020年10月21日	1,338
美元 271,949	离岸人民币 1,855,685	2020年10月21日	1,337
美元 2,646,508	离岸人民币 17,979,246	2020年10月21日	1,277
美元 166,154	离岸人民币 1,134,997	2020年10月21日	996
美元 165,616	离岸人民币 1,130,959	2020年10月21日	940
美元 84,691	纽元 129,548	2020年10月21日	940
美元 238,708	加元 320,050	2020年10月21日	904
美元 82,444	英镑 64,442	2020年10月21日	873
美元 100,493	离岸人民币 688,296	2020年10月21日	872
美元 75,278	离岸人民币 517,000	2020年10月21日	861
美元 75,818	离岸人民币 520,260	2020年10月21日	800
美元 200,297	离岸人民币 1,365,488	2020年10月21日	797
美元 1,440,400	离岸人民币 9,785,964	2020年10月21日	769
美元 80,946	离岸人民币 554,510	2020年10月21日	717
美元 35,627	英镑 28,033	2020年10月21日	617
美元 50,990	离岸人民币 350,035	2020年10月21日	560
美元 63,368	离岸人民币 434,007	2020年10月21日	548
美元 48,491	英镑 37,923	2020年10月21日	539
美元 57,902	离岸人民币 396,734	2020年10月21日	525
美元 83,491	离岸人民币 570,350	2020年10月21日	504
美元 57,109	离岸人民币 391,140	2020年10月21日	494
美元 50,284	离岸人民币 344,539	2020年10月21日	456
美元 61,591	离岸人民币 420,616	2020年10月21日	353
美元 89,259	加元 119,664	2020年10月21日	330
美元 582,489	离岸人民币 3,957,387	2020年10月21日	311
美元 34,552	离岸人民币 236,700	2020年10月21日	306
美元 29,224	离岸人民币 200,160	2020年10月21日	253
美元 58,421	加元 78,309	2020年10月21日	206
美元 15,756	离岸人民币 108,000	2020年10月21日	149
美元 6,473	纽元 9,921	2020年10月21日	84

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
美元 7,001	纽元 10,701	2020年10月21日	73
美元 144,505	离岸人民币 981,703	2020年10月21日	70
美元 10,005	英镑 7,791	2020年10月21日	67
美元 16,721	离岸人民币 113,989	2020年10月21日	67
美元 9,369	英镑 7,286	2020年10月21日	52
美元 4,236	离岸人民币 29,107	2020年10月21日	51
美元 7,322	离岸人民币 50,000	2020年10月21日	42
美元 4,142	离岸人民币 28,388	2020年10月21日	39
美元 7,403	离岸人民币 50,515	2020年10月21日	36
美元 3,256	离岸人民币 22,318	2020年10月21日	30
美元 158,805	加元 212,150	2020年10月21日	26
美元 1,068	澳元 1,521	2020年10月21日	22
美元 8,073	加元 10,812	2020年10月21日	22
美元 2,566	离岸人民币 17,524	2020年10月21日	14
美元 1,060	英镑 829	2020年10月21日	11
美元 1,098	离岸人民币 7,520	2020年10月21日	10
美元 1,138	离岸人民币 7,793	2020年10月21日	10
美元 905	离岸人民币 6,215	2020年10月21日	10
美元 17,663	离岸人民币 120,000	2020年10月21日	9
美元 857	离岸人民币 5,883	2020年10月21日	9
美元 1,464	离岸人民币 10,000	2020年10月21日	8
美元 689	离岸人民币 4,732	2020年10月21日	8
美元 780	离岸人民币 5,344	2020年10月21日	7
美元 819	澳元 1,152	2020年10月21日	7
美元 864	离岸人民币 5,920	2020年10月21日	7
美元 12,159	离岸人民币 82,600	2020年10月21日	6
美元 704	离岸人民币 4,826	2020年10月21日	6
美元 598	离岸人民币 4,098	2020年10月21日	5
美元 800	离岸人民币 5,462	2020年10月21日	5
美元 1,102	离岸人民币 7,517	2020年10月21日	4
美元 772	离岸人民币 5,271	2020年10月21日	4
美元 1,107	离岸人民币 7,519	2020年10月21日	1
美元 970	离岸人民币 6,592	2020年10月21日	1
美元 721	离岸人民币 4,899	2020年10月21日	0
澳元 20,648,074	美元 15,000,000	2020年11月20日	197,396
加元 1,116,632	美元 836,201	2020年11月20日	86
加元 5,428	美元 4,064	2020年11月20日	0
离岸人民币 101,944,650	美元 15,000,000	2020年11月20日	18,935
哥伦比亚比索 54,550,650,000	美元 14,619,156	2020年11月20日	501,775
欧元 12,644,325	美元 15,000,000	2020年11月20日	155,562
欧元 12,731,937	美元 15,000,000	2020年11月20日	52,706
欧元 12,771,474	美元 15,000,000	2020年11月20日	6,290
印尼盾 294,100,000,000	美元 20,000,000	2020年11月20日	354,043
科威特第纳尔 23,500,000,000	美元 20,224,274	2020年11月20日	61,254
墨西哥比索 326,000,000	美元 15,338,367	2020年11月20日	654,476
纽元 22,951,520	美元 15,202,054	2020年11月20日	31,099
纽元 6,221	美元 4,113	2020年11月20日	0
秘鲁索尔 55,000,000	美元 15,408,320	2020年11月20日	120,776
新加坡元 61,313,265	美元 45,000,000	2020年11月20日	81,857
新加坡元 44,001,674	美元 32,250,000	2020年11月20日	14,341
美元 47,321,666	科威特第纳尔 56,322,720,000	2020年11月20日	999,845
美元 14,941,122	科威特第纳尔 17,700,000,000	2020年11月20日	244,654
美元 15,193,155	离岸人民币 105,000,000	2020年11月20日	237,552
美元 14,958,041	科威特第纳尔 17,700,000,000	2020年11月20日	227,792
美元 14,445,049	墨西哥比索 325,000,000	2020年11月20日	194,901

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
美元 17,492,570	新加坡元 24,046,039	2020年11月20日	123,567
美元 14,580,033	离岸人民币 100,000,000	2020年11月20日	115,576
美元 14,705,115	欧元 12,600,000	2020年11月20日	87,185
美元 14,736,383	欧元 12,600,000	2020年11月20日	55,953
美元 14,654,462	离岸人民币 100,000,000	2020年11月20日	40,943
美元 15,192,505	印度卢比 1,124,648,000	2020年11月20日	20,303
美元 892,226	离岸人民币 6,074,004	2020年11月20日	367
美元 313,652	澳元 437,628	2020年11月20日	84
美元 145,069	离岸人民币 987,591	2020年11月20日	60
美元 1,763	离岸人民币 12,000	2020年11月20日	1
美元 1,014	加元 1,354	2020年11月20日	0
美元 1,033	纽元 1,564	2020年11月20日	0
		未实现总收益	14,308,682
澳元 347,799	美元 245,269	2020年10月2日	(4,033)
加元 1,354	美元 1,014	2020年10月5日	(0)
加元 10,812	美元 8,072	2020年10月5日	(22)
加元 78,309	美元 58,419	2020年10月5日	(209)
加元 119,664	美元 89,255	2020年10月5日	(334)
英镑 7,791	美元 10,005	2020年10月5日	(68)
英镑 28,033	美元 35,624	2020年10月5日	(617)
纽元 1,564	美元 1,033	2020年10月5日	(0)
纽元 10,701	美元 7,001	2020年10月5日	(73)
纽元 9,921	美元 6,474	2020年10月5日	(84)
纽元 129,548	美元 84,692	2020年10月5日	(939)
澳元 525,336	美元 373,790	2020年10月6日	(2,771)
澳元 918,243	美元 644,947	2020年10月6日	(13,249)
加元 320,050	美元 238,697	2020年10月6日	(916)
纽元 471,980	美元 310,611	2020年10月6日	(1,368)
美元 4,064	加元 5,428	2020年10月6日	(0)
美元 4,113	纽元 6,221	2020年10月6日	(0)
澳元 437,628	美元 313,618	2020年10月7日	(73)
美元 836,097	加元 1,116,632	2020年10月8日	(107)
离岸人民币 10,000	美元 1,465	2020年10月9日	(8)
离岸人民币 554,510	美元 81,015	2020年10月9日	(696)
离岸人民币 1,134,997	美元 166,311	2020年10月9日	(938)
离岸人民币 1,711,257	美元 250,017	2020年10月9日	(2,146)
离岸人民币 11,961,911	美元 1,747,652	2020年10月9日	(15,003)
离岸人民币 391,140	美元 57,146	2020年10月13日	(491)
离岸人民币 570,350	美元 83,541	2020年10月13日	(503)
离岸人民币 434,007	美元 63,409	2020年10月13日	(545)
离岸人民币 1,621,589	美元 237,520	2020年10月13日	(1,430)
离岸人民币 50,000	美元 7,325	2020年10月14日	(42)
离岸人民币 420,616	美元 61,622	2020年10月14日	(354)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
离岸人民币 12,000	美元 1,767	2020年10月15日	(1)
离岸人民币 987,591	美元 145,443	2020年10月15日	(63)
澳元 1,533	美元 1,089	2020年10月21日	(9)
澳元 4,697	美元 3,344	2020年10月21日	(23)
澳元 164,534	美元 117,077	2020年10月21日	(861)
澳元 76,730	美元 54,112	2020年10月21日	(888)
澳元 342,371	美元 241,392	2020年10月21日	(4,019)
澳元 340,011	美元 238,384	2020年10月21日	(5,336)
澳元 638,480	美元 451,228	2020年10月21日	(6,435)
澳元 1,328,886	美元 944,372	2020年10月21日	(8,174)
澳元 574,955	美元 403,881	2020年10月21日	(8,247)
澳元 909,225	美元 638,167	2020年10月21日	(13,565)
澳元 918,243	美元 644,385	2020年10月21日	(13,812)
加元 1,467	美元 1,098	2020年10月21日	(0)
加元 1,473	美元 1,099	2020年10月21日	(4)
加元 9,710	美元 7,242	2020年10月21日	(28)
加元 78,303	美元 58,466	2020年10月21日	(157)
加元 233,003	美元 174,035	2020年10月21日	(407)
加元 428,444	美元 320,310	2020年10月21日	(453)
加元 240,905	美元 179,711	2020年10月21日	(647)
加元 227,885	美元 169,922	2020年10月21日	(689)
离岸人民币 7,483	美元 1,101	2020年10月21日	(1)
离岸人民币 7,483	美元 1,101	2020年10月21日	(1)
离岸人民币 7,483	美元 1,101	2020年10月21日	(1)
离岸人民币 7,489	美元 1,102	2020年10月21日	(1)
离岸人民币 7,519	美元 1,107	2020年10月21日	(1)
离岸人民币 7,446	美元 1,092	2020年10月21日	(4)
离岸人民币 7,446	美元 1,092	2020年10月21日	(4)
离岸人民币 7,519	美元 1,102	2020年10月21日	(5)
离岸人民币 7,519	美元 1,102	2020年10月21日	(5)
离岸人民币 7,765	美元 1,138	2020年10月21日	(6)
离岸人民币 7,534	美元 1,101	2020年10月21日	(8)
离岸人民币 7,520	美元 1,098	2020年10月21日	(9)
离岸人民币 7,534	美元 1,101	2020年10月21日	(9)
离岸人民币 7,517	美元 1,097	2020年10月21日	(10)
离岸人民币 7,517	美元 1,097	2020年10月21日	(10)
离岸人民币 7,535	美元 1,099	2020年10月21日	(10)
离岸人民币 7,516	美元 1,095	2020年10月21日	(12)
离岸人民币 7,528	美元 1,097	2020年10月21日	(12)
离岸人民币 7,528	美元 1,097	2020年10月21日	(12)
离岸人民币 7,515	美元 1,094	2020年10月21日	(13)
离岸人民币 9,735	美元 1,421	2020年10月21日	(13)
离岸人民币 9,604	美元 1,399	2020年10月21日	(15)
离岸人民币 13,938	美元 2,034	2020年10月21日	(19)
离岸人民币 258,034	美元 37,976	2020年10月21日	(25)
离岸人民币 447,306	美元 65,835	2020年10月21日	(39)
离岸人民币 47,119	美元 6,894	2020年10月21日	(46)
离岸人民币 55,480	美元 8,123	2020年10月21日	(47)
离岸人民币 42,074	美元 6,143	2020年10月21日	(53)
离岸人民币 66,509	美元 9,735	2020年10月21日	(61)
离岸人民币 54,306	美元 7,927	2020年10月21日	(71)
离岸人民币 104,754	美元 15,295	2020年10月21日	(132)
离岸人民币 137,071	美元 20,010	2020年10月21日	(176)
离岸人民币 370,333	美元 54,324	2020年10月21日	(214)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
离岸人民币 192,767	美元 28,142	2020年10月21日	(247)
离岸人民币 312,633	美元 45,781	2020年10月21日	(260)
离岸人民币 199,041	美元 28,982	2020年10月21日	(331)
离岸人民币 4,271,341	美元 628,664	2020年10月21日	(372)
离岸人民币 269,002	美元 39,198	2020年10月21日	(417)
离岸人民币 737,141	美元 108,132	2020年10月21日	(426)
离岸人民币 363,370	美元 53,056	2020年10月21日	(458)
离岸人民币 338,347	美元 49,364	2020年10月21日	(464)
离岸人民币 697,763	美元 102,178	2020年10月21日	(581)
离岸人民币 400,415	美元 58,331	2020年10月21日	(638)
离岸人民币 6,943,584	美元 1,021,904	2020年10月21日	(670)
离岸人民币 390,891	美元 56,882	2020年10月21日	(684)
离岸人民币 1,331,475	美元 195,367	2020年10月21日	(718)
离岸人民币 1,085,726	美元 159,115	2020年10月21日	(779)
离岸人民币 934,099	美元 136,770	2020年10月21日	(794)
离岸人民币 9,379,761	美元 1,380,442	2020年10月21日	(905)
离岸人民币 608,013	美元 88,608	2020年10月21日	(934)
离岸人民币 14,877,873	美元 2,189,753	2020年10月21日	(1,295)
离岸人民币 1,079,205	美元 157,546	2020年10月21日	(1,388)
离岸人民币 1,655,530	美元 242,401	2020年10月21日	(1,407)
离岸人民币 1,474,265	美元 215,228	2020年10月21日	(1,886)
离岸人民币 1,480,040	美元 215,993	2020年10月21日	(1,970)
离岸人民币 1,616,755	美元 235,930	2020年10月21日	(2,168)
离岸人民币 2,081,713	美元 304,348	2020年10月21日	(2,224)
离岸人民币 1,701,206	美元 248,253	2020年10月21日	(2,281)
离岸人民币 1,391,577	美元 202,623	2020年10月21日	(2,313)
离岸人民币 4,574,398	美元 671,021	2020年10月21日	(2,645)
离岸人民币 2,309,143	美元 337,389	2020年10月21日	(2,676)
离岸人民币 2,310,349	美元 337,167	2020年10月21日	(3,076)
离岸人民币 3,766,247	美元 551,451	2020年10月21日	(3,200)
离岸人民币 2,665,271	美元 389,025	2020年10月21日	(3,486)
离岸人民币 4,967,810	美元 728,039	2020年10月21日	(3,565)
离岸人民币 2,825,545	美元 412,238	2020年10月21日	(3,877)
离岸人民币 2,990,264	美元 436,392	2020年10月21日	(3,981)
离岸人民币 3,259,223	美元 475,915	2020年10月21日	(4,068)
离岸人民币 2,947,091	美元 429,300	2020年10月21日	(4,715)
离岸人民币 3,704,382	美元 540,777	2020年10月21日	(4,764)
离岸人民币 3,768,400	美元 550,127	2020年10月21日	(4,841)
离岸人民币 3,896,056	美元 568,762	2020年10月21日	(5,005)
离岸人民币 7,332,499	美元 1,074,588	2020年10月21日	(5,261)
离岸人民币 3,553,664	美元 517,888	2020年10月21日	(5,456)
离岸人民币 4,021,586	美元 585,569	2020年10月21日	(6,686)
离岸人民币 5,632,912	美元 822,463	2020年10月21日	(7,089)
离岸人民币 6,948,207	美元 1,015,831	2020年10月21日	(7,423)
离岸人民币 6,229,169	美元 909,352	2020年10月21日	(8,010)
离岸人民币 7,611,575	美元 1,112,129	2020年10月21日	(8,820)
离岸人民币 7,044,619	美元 1,028,443	2020年10月21日	(9,010)
离岸人民币 5,740,911	美元 836,322	2020年10月21日	(9,136)
离岸人民币 7,221,760	美元 1,054,095	2020年10月21日	(9,446)
离岸人民币 11,711,649	美元 1,715,004	2020年10月21日	(9,758)
离岸人民币 11,076,134	美元 1,620,524	2020年10月21日	(10,646)
离岸人民币 9,657,417	美元 1,410,121	2020年10月21日	(12,116)
离岸人民币 8,783,292	美元 1,280,020	2020年10月21日	(13,486)
离岸人民币 7,838,684	美元 1,140,681	2020年10月21日	(13,713)
离岸人民币 10,255,040	美元 1,496,178	2020年10月21日	(14,070)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
离岸人民币 20,078,957	美元 2,939,394	2020年10月21日	(17,612)
离岸人民币 15,173,422	美元 2,214,009	2020年10月21日	(20,563)
离岸人民币 14,039,646	美元 2,043,041	2020年10月21日	(24,561)
离岸人民币 353,746,484	美元 51,621,475	2020年10月21日	(474,380)
英镑 861	美元 1,109	2020年10月21日	(4)
英镑 855	美元 1,094	2020年10月21日	(12)
英镑 3,699	美元 4,756	2020年10月21日	(27)
英镑 14,766	美元 19,003	2020年10月21日	(88)
英镑 8,617	美元 11,022	2020年10月21日	(118)
英镑 7,908	美元 10,096	2020年10月21日	(128)
英镑 8,552	美元 10,861	2020年10月21日	(197)
英镑 168,448	美元 214,184	2020年10月21日	(3,602)
英镑 440,683	美元 560,874	2020年10月21日	(8,885)
纽元 1,681	美元 1,107	2020年10月21日	(5)
纽元 19,466	美元 12,810	2020年10月21日	(56)
纽元 23,614	美元 15,524	2020年10月21日	(85)
纽元 101,303	美元 66,112	2020年10月21日	(849)
纽元 154,649	美元 101,155	2020年10月21日	(1,068)
纽元 151,327	美元 98,776	2020年10月21日	(1,251)
纽元 288,600	美元 189,214	2020年10月21日	(1,551)
美元 908	离岸人民币 6,156	2020年10月21日	(1)
美元 913	澳元 1,272	2020年10月21日	(1)
美元 1,033	离岸人民币 7,000	2020年10月21日	(2)
美元 1,066	英镑 823	2020年10月21日	(2)
美元 1,068	纽元 1,608	2020年10月21日	(5)
美元 1,070	纽元 1,608	2020年10月21日	(7)
美元 1,078	英镑 827	2020年10月21日	(8)
美元 559	纽元 830	2020年10月21日	(10)
美元 921	澳元 1,271	2020年10月21日	(10)
美元 1,063	加元 1,401	2020年10月21日	(14)
美元 1,095	加元 1,444	2020年10月21日	(14)
美元 838	纽元 1,247	2020年10月21日	(14)
美元 922	加元 1,210	2020年10月21日	(16)
美元 1,037	澳元 1,423	2020年10月21日	(17)
美元 1,106	纽元 1,649	2020年10月21日	(17)
美元 1,064	澳元 1,442	2020年10月21日	(31)
美元 1,101	澳元 1,487	2020年10月21日	(35)
美元 4,810	英镑 3,691	2020年10月21日	(38)
美元 35,537	离岸人民币 241,040	2020年10月21日	(39)
美元 12,140	英镑 9,359	2020年10月21日	(40)
美元 6,334	纽元 9,493	2020年10月21日	(59)
美元 2,769	英镑 2,095	2020年10月21日	(60)
美元 23,631	离岸人民币 160,000	2020年10月21日	(68)
美元 17,258	加元 22,956	2020年10月21日	(71)
美元 14,079	英镑 10,823	2020年10月21日	(87)
美元 3,454	英镑 2,602	2020年10月21日	(90)
美元 13,681	纽元 20,385	2020年10月21日	(206)
美元 39,840	英镑 30,654	2020年10月21日	(208)
美元 178,674	澳元 248,966	2020年10月21日	(215)
美元 150,667	加元 200,872	2020年10月21日	(280)
美元 138,760	离岸人民币 940,310	2020年10月21日	(281)
美元 68,688	纽元 103,469	2020年10月21日	(295)
美元 49,175	纽元 73,892	2020年10月21日	(333)
美元 17,043	纽元 25,247	2020年10月21日	(355)
美元 17,469	澳元 23,865	2020年10月21日	(363)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
美元 365,133	离岸人民币 2,476,614	2020年10月21日	(405)
美元 288,442	离岸人民币 1,954,637	2020年10月21日	(585)
美元 51,391	澳元 70,525	2020年10月21日	(839)
美元 79,440	纽元 118,379	2020年10月21日	(1,191)
美元 136,001	纽元 203,857	2020年10月21日	(1,252)
美元 92,700	澳元 127,088	2020年10月21日	(1,603)
美元 152,001	纽元 227,503	2020年10月21日	(1,621)
美元 81,303	加元 106,338	2020年10月21日	(1,691)
美元 78,996	纽元 116,946	2020年10月21日	(1,694)
美元 1,689,501	离岸人民币 11,459,515	2020年10月21日	(1,872)
美元 113,090	纽元 168,187	2020年10月21日	(1,918)
美元 436,186	纽元 656,854	2020年10月21日	(2,006)
美元 192,997	加元 254,855	2020年10月21日	(2,195)
美元 131,571	纽元 195,717	2020年10月21日	(2,202)
美元 74,659	澳元 100,849	2020年10月21日	(2,372)
美元 497,973	澳元 691,185	2020年10月21日	(2,532)
美元 906,916	离岸人民币 6,140,585	2020年10月21日	(2,601)
美元 279,234	澳元 385,866	2020年10月21日	(2,646)
美元 158,560	澳元 217,002	2020年10月21日	(3,013)
美元 110,698	英镑 83,183	2020年10月21日	(3,150)
美元 1,194,628	离岸人民币 8,088,633	2020年10月21日	(3,426)
美元 198,790	英镑 150,827	2020年10月21日	(3,785)
美元 227,206	加元 298,222	2020年10月21日	(3,936)
美元 372,521	加元 492,191	2020年10月21日	(4,031)
美元 330,668	加元 436,096	2020年10月21日	(4,175)
美元 335,532	加元 442,592	2020年10月21日	(4,175)
美元 341,050	加元 449,261	2020年10月21日	(4,701)
美元 210,710	澳元 287,376	2020年10月21日	(4,718)
美元 279,174	澳元 382,549	2020年10月21日	(4,963)
美元 396,999	纽元 592,934	2020年10月21日	(5,070)
美元 297,564	澳元 407,968	2020年10月21日	(5,133)
美元 432,099	加元 569,532	2020年10月21日	(5,707)
美元 382,537	澳元 525,393	2020年10月21日	(5,935)
美元 473,490	澳元 650,731	2020年10月21日	(7,046)
美元 318,548	加元 416,030	2020年10月21日	(7,078)
美元 519,550	加元 683,945	2020年10月21日	(7,499)
美元 782,093	澳元 1,079,285	2020年10月21日	(8,462)
美元 612,225	澳元 841,324	2020年10月21日	(9,163)
美元 500,091	澳元 684,727	2020年10月21日	(9,278)
美元 692,524	加元 912,400	2020年10月21日	(9,437)
美元 453,703	纽元 671,857	2020年10月21日	(9,606)
美元 439,662	加元 573,679	2020年10月21日	(10,164)
美元 266,238	英镑 197,944	2020年10月21日	(10,316)
美元 759,237	加元 1,000,000	2020年10月21日	(10,565)
美元 977,706	加元 1,288,000	2020年10月21日	(13,417)
美元 958,475	澳元 1,314,854	2020年10月21日	(15,986)
美元 557,582	澳元 755,425	2020年10月21日	(16,092)
美元 10,819,342	离岸人民币 73,317,713	2020年10月21日	(21,935)
美元 1,695,957	加元 2,224,252	2020年10月21日	(30,722)
美元 5,721,064	英镑 4,335,966	2020年10月21日	(115,085)
美元 60,583,742	纽元 90,338,995	2020年10月21日	(869,666)
美元 101,496,846	加元 133,037,772	2020年10月21日	(1,895,237)
美元 151,058,515	澳元 207,275,310	2020年10月21日	(2,483,399)
澳元 1,545	美元 1,108	2020年11月20日	(0)
澳元 20,717	美元 14,848	2020年11月20日	(4)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
离岸人民币 7,505	美元 1,102	2020年11月20日	(0)
离岸人民币 17,889	美元 2,628	2020年11月20日	(1)
离岸人民币 7,505	美元 1,102	2020年11月20日	(1)
离岸人民币 973,310	美元 142,976	2020年11月20日	(55)
离岸人民币 2,082,609	美元 305,927	2020年11月20日	(118)
离岸人民币 205,421,460	美元 30,000,000	2020年11月20日	(187,286)
离岸人民币 748,802,093	美元 108,726,338	2020年11月20日	(1,312,325)
印尼盾 300,820,000,000	美元 20,000,000	2020年11月20日	(94,855)
印度卢比 1,124,648,000	美元 15,100,000	2020年11月20日	(112,768)
印度卢比 2,379,360,000	美元 32,000,000	2020年11月20日	(184,872)
科威特第纳尔 17,200,000,000	美元 14,754,830	2020年11月20日	(2,785)
林吉特 62,623,500	美元 15,000,000	2020年11月20日	(47,577)
菲律宾比索 729,495,000	美元 15,000,000	2020年11月20日	(21,652)
菲律宾比索 729,870,000	美元 15,000,000	2020年11月20日	(29,374)
新加坡元 20,231,100	美元 14,750,000	2020年11月20日	(71,319)
台币 446,074,400	美元 15,356,987	2020年11月20日	(144,248)
美元 5,333	纽元 8,067	2020年11月20日	(0)
美元 125,377	加元 167,424	2020年11月20日	(13)
美元 15,020,560	新加坡元 20,500,000	2020年11月20日	(2,245)
美元 15,184,863	纽元 22,951,520	2020年11月20日	(13,909)
美元 14,693,188	新加坡元 20,000,000	2020年11月20日	(41,170)
美元 15,110,390	林吉特 62,623,500	2020年11月20日	(62,907)
美元 14,764,277	墨西哥比索 326,000,000	2020年11月20日	(80,843)
美元 14,746,381	新加坡元 20,000,000	2020年11月20日	(94,359)
美元 15,030,518	日元 1,570,000,000	2020年11月20日	(143,063)
美元 14,879,946	印尼盾 220,000,000,000	2020年11月20日	(185,000)
美元 30,221,947	新加坡元 41,000,000	2020年11月20日	(185,303)
美元 15,588,685	秘鲁索尔 55,000,000	2020年11月20日	(301,199)
美元 15,103,901	澳元 20,648,074	2020年11月20日	(301,234)
美元 14,787,381	哥伦比亚比索 54,550,650,000	2020年11月20日	(671,691)
美元 15,590,159	巴西雷亚尔 83,200,000	2020年11月20日	(847,212)
美元 15,000,000	巴西雷亚尔 79,798,350	2020年11月20日	(859,876)
美元 30,000,000	台币 859,560,000	2020年11月30日	(85,768)
		未实现总亏损	(12,639,189)
		未实现净收益	1,669,493

2019

未平仓合约:

澳元 427,566	美元 290,535	2019年10月2日	2,142
纽元 328,253	美元 207,594	2019年10月2日	1,746
美元 1,101	加元 1,460	2019年10月2日	2
澳元 769,671	美元 520,127	2019年10月3日	984
澳元 31,910	美元 21,616	2019年10月4日	93
加元 249,680	美元 188,678	2019年10月4日	98
纽元 132,898	美元 83,843	2019年10月4日	502
澳元 64,838	美元 43,741	2019年10月8日	1
离岸人民币 23,250,635	美元 3,267,818	2019年10月8日	11,974
离岸人民币 6,724,191	美元 945,068	2019年10月8日	3,463
离岸人民币 4,350,741	美元 610,300	2019年10月8日	1,055

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
离岸人民币 705,500	美元 99,156	2019年10月8日	363
美元 223,805	加元 296,321	2019年10月8日	19
离岸人民币 11,251,010	美元 1,578,146	2019年10月9日	2,639
离岸人民币 8,217,932	美元 1,152,705	2019年10月9日	1,927
离岸人民币 10,704	美元 1,504	2019年10月9日	5
离岸人民币 7,035,279	美元 986,366	2019年10月10日	1,227
离岸人民币 1,100,300	美元 154,319	2019年10月10日	246
离岸人民币 11,228,901	美元 1,578,001	2019年10月11日	5,679
离岸人民币 3,731,500	美元 524,389	2019年10月11日	1,887
澳元 1,156,568	美元 795,811	2019年10月21日	15,243
澳元 886,114	美元 608,410	2019年10月21日	10,371
澳元 618,359	美元 425,514	2019年10月21日	8,184
澳元 572,268	美元 394,407	2019年10月21日	8,184
澳元 621,195	美元 423,838	2019年10月21日	4,593
澳元 305,709	美元 209,866	2019年10月21日	3,543
澳元 262,178	美元 180,450	2019年10月21日	3,506
澳元 238,750	美元 163,963	2019年10月21日	2,831
澳元 422,363	美元 287,163	2019年10月21日	2,110
澳元 141,686	美元 97,256	2019年10月21日	1,632
澳元 124,542	美元 85,549	2019年10月21日	1,496
澳元 304,600	美元 206,519	2019年10月21日	944
澳元 577,838	美元 390,901	2019年10月21日	918
澳元 120,168	美元 81,960	2019年10月21日	859
澳元 56,868	美元 38,948	2019年10月21日	568
澳元 39,104	美元 26,617	2019年10月21日	226
澳元 144,920	美元 97,947	2019年10月21日	140
澳元 6,183	美元 4,204	2019年10月21日	32
澳元 7,772	美元 5,268	2019年10月21日	23
澳元 1,614	美元 1,108	2019年10月21日	19
澳元 1,598	美元 1,097	2019年10月21日	19
澳元 1,603	美元 1,101	2019年10月21日	18
澳元 1,608	美元 1,094	2019年10月21日	9
澳元 1,624	美元 1,104	2019年10月21日	8
澳元 2,082	美元 1,412	2019年10月21日	7
澳元 1,629	美元 1,101	2019年10月21日	2
加元 1,062,730	美元 807,406	2019年10月21日	4,558
加元 296,884	美元 225,780	2019年10月21日	1,496
加元 392,136	美元 297,288	2019年10月21日	1,046
加元 362,422	美元 274,724	2019年10月21日	930
加元 39,622	美元 30,144	2019年10月21日	211
加元 484,018	美元 365,725	2019年10月21日	70
加元 210,881	美元 159,357	2019年10月21日	45
加元 1,447	美元 1,099	2019年10月21日	6
加元 11,684	美元 8,831	2019年10月21日	5
离岸人民币 48,478,381	美元 6,860,565	2019年10月21日	74,300
离岸人民币 49,028,120	美元 6,919,310	2019年10月21日	56,087
离岸人民币 39,215,711	美元 5,529,831	2019年10月21日	40,203
离岸人民币 39,616,331	美元 5,579,048	2019年10月21日	33,339
离岸人民币 30,239,187	美元 4,264,344	2019年10月21日	31,298
离岸人民币 16,676,978	美元 2,354,511	2019年10月21日	19,977
离岸人民币 40,272,439	美元 5,653,840	2019年10月21日	16,285
离岸人民币 26,081,729	美元 3,664,368	2019年10月21日	13,306
离岸人民币 27,093,713	美元 3,804,183	2019年10月21日	11,458
离岸人民币 9,506,960	美元 1,342,294	2019年10月21日	11,458
离岸人民币 22,512,987	美元 3,162,328	2019年10月21日	10,837

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
离岸人民币 9,448,552	美元 1,332,627	2019年10月21日	9,967
离岸人民币 18,498,317	美元 2,599,284	2019年10月21日	9,789
离岸人民币 4,666,426	美元 662,968	2019年10月21日	9,736
离岸人民币 17,964,403	美元 2,524,222	2019年10月21日	9,467
离岸人民币 7,500,363	美元 1,057,631	2019年10月21日	7,689
离岸人民币 6,043,421	美元 853,417	2019年10月21日	7,426
离岸人民币 6,274,637	美元 884,852	2019年10月21日	6,494
离岸人民币 5,643,617	美元 796,480	2019年10月21日	6,456
离岸人民币 11,007,382	美元 1,545,537	2019年10月21日	4,664
离岸人民币 4,629,308	美元 651,931	2019年10月21日	3,896
离岸人民币 2,281,951	美元 322,937	2019年10月21日	3,497
离岸人民币 6,739,561	美元 946,933	2019年10月21日	3,493
离岸人民币 2,434,882	美元 343,633	2019年10月21日	2,785
离岸人民币 5,458,251	美元 766,860	2019年10月21日	2,785
离岸人民币 2,137,552	美元 301,787	2019年10月21日	2,561
离岸人民币 4,828,220	美元 678,435	2019年10月21日	2,555
离岸人民币 13,489,892	美元 1,890,908	2019年10月21日	2,520
离岸人民币 10,330,398	美元 1,448,573	2019年10月21日	2,468
离岸人民币 1,467,395	美元 207,663	2019年10月21日	2,249
离岸人民币 4,843,769	美元 680,012	2019年10月21日	1,955
离岸人民币 3,879,951	美元 545,004	2019年10月21日	1,868
离岸人民币 1,441,573	美元 203,320	2019年10月21日	1,521
离岸人民币 2,809,386	美元 394,625	2019年10月21日	1,352
离岸人民币 5,232,459	美元 733,718	2019年10月21日	1,250
离岸人民币 3,084,518	美元 433,035	2019年10月21日	1,247
离岸人民币 5,381,263	美元 754,302	2019年10月21日	1,004
离岸人民币 716,153	美元 100,992	2019年10月21日	741
离岸人民币 1,204,217	美元 169,208	2019年10月21日	635
离岸人民币 520,989	美元 73,559	2019年10月21日	628
离岸人民币 1,456,748	美元 204,513	2019年10月21日	589
离岸人民币 793,453	美元 111,490	2019年10月21日	418
离岸人民币 769,137	美元 108,060	2019年10月21日	392
离岸人民币 324,991	美元 45,827	2019年10月21日	333
离岸人民币 130,736	美元 18,573	2019年10月21日	272
离岸人民币 490,589	美元 68,935	2019年10月21日	260
离岸人民币 600,000	美元 84,242	2019年10月21日	251
离岸人民币 169,396	美元 23,921	2019年10月21日	208
离岸人民币 217,874	美元 30,683	2019年10月21日	183
离岸人民币 121,671	美元 17,171	2019年10月21日	139
离岸人民币 78,334	美元 11,032	2019年10月21日	66
离岸人民币 127,308	美元 17,886	2019年10月21日	65
离岸人民币 30,024	美元 4,265	2019年10月21日	62
离岸人民币 257,605	美元 36,122	2019年10月21日	61
离岸人民币 107,894	美元 15,159	2019年10月21日	56
离岸人民币 69,476	美元 9,754	2019年10月21日	28
离岸人民币 35,947	美元 5,051	2019年10月21日	19
离岸人民币 7,784	美元 1,106	2019年10月21日	16
离岸人民币 7,784	美元 1,106	2019年10月21日	16
离岸人民币 7,736	美元 1,095	2019年10月21日	12
离岸人民币 7,805	美元 1,101	2019年10月21日	8
离岸人民币 7,789	美元 1,097	2019年10月21日	7
离岸人民币 7,789	美元 1,097	2019年10月21日	7
离岸人民币 12,554	美元 1,764	2019年10月21日	7
离岸人民币 7,789	美元 1,097	2019年10月21日	7
离岸人民币 7,826	美元 1,100	2019年10月21日	4

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
离岸人民币 7,858	美元 1,104	2019年10月21日	4
离岸人民币 7,828	美元 1,100	2019年10月21日	4
离岸人民币 7,794	美元 1,095	2019年10月21日	4
离岸人民币 7,826	美元 1,100	2019年10月21日	4
离岸人民币 7,828	美元 1,099	2019年10月21日	3
离岸人民币 14,743	美元 2,067	2019年10月21日	3
离岸人民币 7,828	美元 1,099	2019年10月21日	3
离岸人民币 7,826	美元 1,097	2019年10月21日	2
离岸人民币 7,826	美元 1,097	2019年10月21日	2
纽元 1,216,366	美元 775,641	2019年10月21日	12,615
纽元 630,066	美元 404,986	2019年10月21日	9,746
纽元 579,278	美元 372,142	2019年10月21日	8,761
纽元 255,986	美元 164,567	2019年10月21日	3,986
纽元 312,233	美元 199,585	2019年10月21日	3,722
纽元 667,772	美元 422,494	2019年10月21日	3,601
纽元 280,943	美元 179,247	2019年10月21日	3,012
纽元 74,808	美元 48,034	2019年10月21日	1,107
纽元 85,209	美元 54,178	2019年10月21日	726
纽元 76,556	美元 48,441	2019年10月21日	418
纽元 28,359	美元 18,037	2019年10月21日	247
纽元 169,414	美元 106,467	2019年10月21日	193
纽元 36,575	美元 23,129	2019年10月21日	185
纽元 10,492	美元 6,760	2019年10月21日	179
纽元 21,205	美元 13,436	2019年10月21日	134
纽元 20,632	美元 13,021	2019年10月21日	79
纽元 26,670	美元 16,781	2019年10月21日	50
纽元 1,909	美元 1,229	2019年10月21日	31
纽元 1,712	美元 1,095	2019年10月21日	20
纽元 1,731	美元 1,104	2019年10月21日	18
纽元 1,722	美元 1,095	2019年10月21日	15
纽元 1,744	美元 1,107	2019年10月21日	14
纽元 1,750	美元 1,107	2019年10月21日	9
纽元 1,741	美元 1,100	2019年10月21日	8
纽元 1,738	美元 1,097	2019年10月21日	7
纽元 1,751	美元 1,105	2019年10月21日	6
英镑 63,522	美元 78,422	2019年10月21日	86
英镑 6,867	美元 8,543	2019年10月21日	75
英镑 6,701	美元 8,299	2019年10月21日	35
英镑 886	美元 1,107	2019年10月21日	15
英镑 5,741	美元 7,085	2019年10月21日	5
美元 3,943,005	离岸人民币 28,335,566	2019年10月21日	23,570
美元 2,341,553	离岸人民币 16,842,316	2019年10月21日	16,131
美元 1,755,109	离岸人民币 12,624,141	2019年10月21日	12,091
美元 2,972,122	离岸人民币 21,303,615	2019年10月21日	10,077
美元 4,514,046	英镑 3,665,031	2019年10月21日	5,666
美元 488,227	离岸人民币 3,508,427	2019年10月21日	2,902
美元 1,731,337	离岸人民币 12,387,619	2019年10月21日	2,750
美元 729,990	离岸人民币 5,224,499	2019年10月21日	1,364
美元 1,620,749	离岸人民币 11,587,676	2019年10月21日	1,358
美元 1,655,486	纽元 2,641,085	2019年10月21日	1,266
美元 746,017	加元 988,991	2019年10月21日	1,124
美元 726,076	加元 962,391	2019年10月21日	971
美元 260,328	离岸人民币 1,865,877	2019年10月21日	868
美元 160,743	加元 213,887	2019年10月21日	839
美元 119,014	加元 158,646	2019年10月21日	836

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
美元 126,623	离岸人民币 910,000	2019年10月21日	764
美元 645,569	离岸人民币 4,615,495	2019年10月21日	533
美元 264,416	加元 350,702	2019年10月21日	525
美元 70,904	离岸人民币 510,000	2019年10月21日	488
美元 148,056	加元 196,495	2019年10月21日	388
美元 230,035	加元 304,945	2019年10月21日	339
美元 97,674	离岸人民币 700,110	2019年10月21日	331
美元 111,956	加元 148,581	2019年10月21日	291
美元 162,127	离岸人民币 1,160,011	2019年10月21日	258
美元 120,639	加元 159,960	2019年10月21日	203
美元 62,063	加元 82,400	2019年10月21日	186
美元 156,595	加元 207,485	2019年10月21日	152
美元 52,777	离岸人民币 377,722	2019年10月21日	99
美元 32,442	加元 43,038	2019年10月21日	71
美元 34,251	澳元 50,842	2019年10月21日	62
美元 53,676	英镑 43,562	2019年10月21日	45
美元 4,807	离岸人民币 34,543	2019年10月21日	29
美元 32,177	离岸人民币 230,050	2019年10月21日	27
美元 146,400	澳元 216,942	2019年10月21日	13
美元 1,874	离岸人民币 13,469	2019年10月21日	11
美元 4,026	澳元 5,975	2019年10月21日	6
林吉特 82,996,000	美元 20,000,000	2019年11月15日	189,521
林吉特 111,089,450	美元 26,691,362	2019年11月15日	175,203
林吉特 66,969,600	美元 16,000,000	2019年11月15日	14,894
林吉特 54,405,000	美元 13,000,000	2019年11月15日	13,963
离岸人民币 17,729,408	美元 2,479,876	2019年11月21日	100
离岸人民币 6,267,170	美元 876,612	2019年11月21日	34
离岸人民币 670,782	美元 93,825	2019年11月21日	4
美元 57,122	纽元 91,006	2019年11月21日	11
美元 43,803	澳元 64,838	2019年11月21日	1
澳元 23,307,612	美元 16,000,000	2019年11月25日	253,377
澳元 8,812,572	美元 6,000,000	2019年11月25日	46,226
澳元 11,811,483	美元 8,000,000	2019年11月25日	20,162
离岸人民币 309,477,600	美元 45,000,000	2019年11月25日	1,718,237
离岸人民币 404,186,340	美元 58,000,000	2019年11月25日	1,472,815
离岸人民币 350,000,000	美元 50,370,279	2019年11月25日	1,421,285
离岸人民币 145,205,760	美元 21,000,000	2019年11月25日	692,354
离岸人民币 461,175,000	美元 65,000,000	2019年11月25日	502,707
离岸人民币 163,822,790	美元 23,000,000	2019年11月25日	88,683
离岸人民币 42,751,260	美元 6,000,000	2019年11月25日	21,054
印尼盾 601,449,000,000	美元 42,731,723	2019年11月25日	588,335
印尼盾 249,287,500,000	美元 17,500,000	2019年11月25日	32,484
印尼盾 442,277,000,000	美元 31,000,000	2019年11月25日	9,755
印度卢比 1,230,985,000	美元 17,500,000	2019年11月25日	203,427
韩元 38,565,800,000	美元 32,600,000	2019年11月25日	393,074
韩元 18,902,560,000	美元 16,000,000	2019年11月25日	214,165
韩元 15,373,930,000	美元 13,000,000	2019年11月25日	160,981
墨西哥比索 157,989,664	美元 8,000,000	2019年11月25日	66,920
墨西哥比索 258,854,630	美元 13,034,101	2019年11月25日	36,323
菲律宾比索 836,973,000	美元 16,200,000	2019年11月25日	77,515
美元 99,360,854	离岸人民币 712,443,750	2019年11月25日	277,802
美元 17,101,764	印度卢比 1,230,985,000	2019年11月25日	195,635
美元 7,855,238	墨西哥比索 160,000,000	2019年11月25日	180,337
美元 15,995,662	菲律宾比索 836,973,000	2019年11月25日	127,027
美元 12,028,123	新加坡元 16,644,456	2019年11月25日	15,612

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
美元 5,956,068	林吉特 25,000,000	2019年11月25日	10,384
哥伦比亚比索 54,016,000,000	美元 16,000,000	2019年12月10日	520,348
哥伦比亚比索 51,023,700,000	美元 14,700,000	2019年12月10日	77,866
墨西哥比索 315,877,760	美元 16,000,000	2019年12月19日	195,444
印度卢比 4,189,924,808	美元 58,493,994	2020年2月28日	292,753
离岸人民币 396,206,807	美元 56,781,969	2020年5月15日	1,584,588
美元 34,873,507	离岸人民币 251,206,807	2020年5月15日	123,897

未实现总收益 12,695,707

加元 43,038	美元 32,432	2019年10月2日	(74)
加元 962,391	美元 725,865	2019年10月2日	(1,017)
美元 1,101	澳元 1,629	2019年10月2日	(2)
美元 1,104	纽元 1,751	2019年10月2日	(6)
美元 97,878	澳元 144,920	2019年10月2日	(129)
美元 106,422	纽元 169,414	2019年10月2日	(182)
加元 988,991	美元 745,811	2019年10月3日	(1,161)
美元 8,829	加元 11,684	2019年10月3日	(4)
美元 5,265	澳元 7,772	2019年10月3日	(22)
英镑 43,562	美元 53,641	2019年10月4日	(45)
美元 1,257	澳元 1,864	2019年10月4日	(0)
美元 3,876	加元 5,132	2019年10月4日	(0)
美元 1,101	英镑 893	2019年10月4日	(0)
美元 1,093	纽元 1,744	2019年10月4日	(0)
纽元 91,006	美元 57,065	2019年10月8日	(4)
美元 754,457	离岸人民币 5,381,263	2019年10月8日	(905)
美元 733,983	离岸人民币 5,232,459	2019年10月8日	(1,268)
美元 1,449,095	离岸人民币 10,330,398	2019年10月8日	(2,504)
美元 36,129	离岸人民币 257,605	2019年10月9日	(56)
美元 1,891,280	离岸人民币 13,489,892	2019年10月9日	(2,257)
美元 15,163	离岸人民币 107,894	2019年10月10日	(55)
美元 947,172	离岸人民币 6,739,561	2019年10月10日	(3,441)
美元 93,929	离岸人民币 670,782	2019年10月11日	(3)
美元 2,482,629	离岸人民币 17,729,408	2019年10月11日	(75)
离岸人民币 1,156,000	美元 161,846	2019年10月15日	(4)
离岸人民币 12,803,798	美元 1,792,601	2019年10月15日	(45)
澳元 2,691,233	美元 1,815,974	2019年10月21日	(339)
澳元 1,888,764	美元 1,272,498	2019年10月21日	(2,229)
加元 1,452	美元 1,097	2019年10月21日	(0)
加元 1,459	美元 1,100	2019年10月21日	(2)
加元 1,459	美元 1,100	2019年10月21日	(2)
加元 1,460	美元 1,102	2019年10月21日	(2)
加元 1,463	美元 1,102	2019年10月21日	(3)
加元 1,620	美元 1,220	2019年10月21日	(3)
加元 145,308	美元 109,680	2019年10月21日	(94)
加元 102,001	美元 76,963	2019年10月21日	(95)
加元 203,382	美元 153,347	2019年10月21日	(299)
加元 566,963	美元 427,639	2019年10月21日	(677)
加元 821,075	美元 619,394	2019年10月21日	(894)
加元 406,658	美元 305,616	2019年10月21日	(1,597)
加元 1,151,965	美元 864,285	2019年10月21日	(5,977)
离岸人民币 7,865	美元 1,100	2019年10月21日	(1)
离岸人民币 7,865	美元 1,100	2019年10月21日	(1)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
离岸人民币 7,865	美元 1,100	2019年10月21日	(1)
离岸人民币 43,576	美元 6,095	2019年10月21日	(5)
离岸人民币 110,890	美元 15,510	2019年10月21日	(13)
离岸人民币 43,769	美元 6,107	2019年10月21日	(20)
离岸人民币 203,630	美元 28,462	2019年10月21日	(43)
离岸人民币 240,760	美元 33,504	2019年10月21日	(199)
离岸人民币 301,127	美元 41,865	2019年10月21日	(288)
离岸人民币 732,353	美元 101,904	2019年10月21日	(615)
离岸人民币 10,185,091	美元 1,424,673	2019年10月21日	(1,092)
离岸人民币 2,696,884	美元 376,263	2019年10月21日	(1,262)
离岸人民币 5,329,718	美元 744,760	2019年10月21日	(1,323)
离岸人民币 14,586,188	美元 2,039,994	2019年10月21日	(1,860)
离岸人民币 22,432,341	美元 3,137,488	2019年10月21日	(2,713)
离岸人民币 7,010,803	美元 978,130	2019年10月21日	(3,280)
离岸人民币 4,020,197	美元 559,221	2019年10月21日	(3,548)
离岸人民币 8,114,043	美元 1,132,141	2019年10月21日	(3,707)
离岸人民币 6,050,638	美元 841,996	2019年10月21日	(5,007)
离岸人民币 27,420,487	美元 3,832,626	2019年10月21日	(5,843)
离岸人民币 21,890,915	美元 3,046,188	2019年10月21日	(18,221)
离岸人民币 19,379,816	美元 2,694,358	2019年10月21日	(18,534)
离岸人民币 33,687,111	美元 4,683,488	2019年10月21日	(32,217)
纽元 4,376	美元 2,743	2019年10月21日	(2)
英镑 1,820	美元 2,244	2019年10月21日	(0)
美元 3,839	加元 5,082	2019年10月21日	(0)
美元 1,103	离岸人民币 7,858	2019年10月21日	(3)
美元 1,096	离岸人民币 7,805	2019年10月21日	(4)
美元 1,504	离岸人民币 10,704	2019年10月21日	(6)
美元 2,294	离岸人民币 16,330	2019年10月21日	(8)
美元 2,502	离岸人民币 17,811	2019年10月21日	(9)
美元 1,140	离岸人民币 8,081	2019年10月21日	(9)
美元 1,319	英镑 1,061	2019年10月21日	(11)
美元 4,016	离岸人民币 28,444	2019年10月21日	(34)
美元 4,411	离岸人民币 31,253	2019年10月21日	(36)
美元 5,460	离岸人民币 38,721	2019年10月21日	(40)
美元 21,996	离岸人民币 156,776	2019年10月21日	(50)
美元 21,628	澳元 31,910	2019年10月21日	(92)
美元 9,151	英镑 7,340	2019年10月21日	(98)
美元 399,868	加元 529,170	2019年10月21日	(102)
美元 188,726	加元 249,680	2019年10月21日	(103)
美元 21,764	离岸人民币 154,710	2019年10月21日	(108)
美元 130,596	英镑 105,793	2019年10月21日	(132)
美元 35,507	加元 46,743	2019年10月21日	(195)
美元 28,563	加元 37,548	2019年10月21日	(197)
美元 73,289	离岸人民币 521,973	2019年10月21日	(221)
美元 62,993	离岸人民币 448,320	2019年10月21日	(235)
美元 154,287	离岸人民币 1,100,300	2019年10月21日	(261)
美元 89,703	纽元 142,579	2019年10月21日	(264)
美元 84,280	离岸人民币 600,000	2019年10月21日	(289)
美元 99,896	离岸人民币 711,010	2019年10月21日	(365)
美元 99,129	离岸人民币 705,500	2019年10月21日	(370)
美元 85,601	纽元 135,820	2019年10月21日	(401)
美元 36,071	纽元 56,800	2019年10月21日	(440)
美元 133,802	离岸人民币 952,278	2019年10月21日	(497)
美元 83,875	纽元 132,898	2019年10月21日	(508)
美元 78,998	离岸人民币 560,200	2019年10月21日	(578)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
美元 65,213	澳元 95,622	2019年10月21日	(677)
美元 137,048	加元 180,425	2019年10月21日	(744)
美元 102,601	纽元 162,269	2019年10月21日	(809)
美元 520,431	澳元 769,671	2019年10月21日	(979)
美元 610,080	离岸人民币 4,350,741	2019年10月21日	(1,040)
美元 125,837	纽元 198,899	2019年10月21日	(1,067)
美元 233,615	澳元 344,558	2019年10月21日	(1,073)
美元 65,401	澳元 95,212	2019年10月21日	(1,142)
美元 51,050	纽元 79,470	2019年10月21日	(1,198)
美元 141,882	澳元 208,442	2019年10月21日	(1,204)
美元 986,162	离岸人民币 7,035,279	2019年10月21日	(1,326)
美元 376,032	离岸人民币 2,676,413	2019年10月21日	(1,374)
美元 213,415	澳元 313,977	2019年10月21日	(1,512)
美元 459,349	离岸人民币 3,270,151	2019年10月21日	(1,576)
美元 300,183	离岸人民币 2,133,012	2019年10月21日	(1,593)
美元 286,622	纽元 454,194	2019年10月21日	(1,705)
美元 291,518	离岸人民币 2,070,000	2019年10月21日	(1,749)
美元 207,682	纽元 328,253	2019年10月21日	(1,768)
美元 227,093	离岸人民币 1,609,200	2019年10月21日	(1,829)
美元 137,529	纽元 216,308	2019年10月21日	(1,838)
美元 232,441	离岸人民币 1,647,098	2019年10月21日	(1,873)
美元 273,326	纽元 432,713	2019年10月21日	(1,884)
美元 428,729	澳元 632,412	2019年10月21日	(1,913)
美元 524,270	离岸人民币 3,731,500	2019年10月21日	(1,915)
美元 1,152,340	离岸人民币 8,217,932	2019年10月21日	(1,950)
美元 285,745	澳元 420,318	2019年10月21日	(2,072)
美元 609,433	离岸人民币 4,338,616	2019年10月21日	(2,091)
美元 704,980	离岸人民币 5,020,927	2019年10月21日	(2,124)
美元 215,719	纽元 340,497	2019年10月21日	(2,125)
美元 290,726	澳元 427,566	2019年10月21日	(2,160)
美元 313,105	离岸人民币 2,220,345	2019年10月21日	(2,290)
美元 647,225	离岸人民币 4,606,174	2019年10月21日	(2,428)
美元 98,685	纽元 153,350	2019年10月21日	(2,488)
美元 139,348	纽元 218,000	2019年10月21日	(2,596)
美元 154,071	澳元 224,352	2019年10月21日	(2,654)
美元 1,577,646	离岸人民币 11,251,010	2019年10月21日	(2,670)
美元 138,835	澳元 201,451	2019年10月21日	(2,874)
美元 132,022	纽元 205,403	2019年10月21日	(3,172)
美元 874,578	离岸人民币 6,224,837	2019年10月21日	(3,193)
美元 565,471	离岸人民币 4,015,275	2019年10月21日	(3,392)
美元 944,811	离岸人民币 6,724,191	2019年10月21日	(3,524)
美元 551,794	加元 725,595	2019年10月21日	(3,637)
美元 1,247,351	离岸人民币 8,884,300	2019年10月21日	(3,679)
美元 619,587	离岸人民币 4,399,537	2019年10月21日	(3,717)
美元 545,297	离岸人民币 3,866,896	2019年10月21日	(3,989)
美元 823,376	离岸人民币 5,852,991	2019年10月21日	(4,044)
美元 508,429	离岸人民币 3,601,356	2019年10月21日	(4,293)
美元 171,579	纽元 266,310	2019年10月21日	(4,521)
美元 619,757	离岸人民币 4,394,923	2019年10月21日	(4,534)
美元 242,097	澳元 351,750	2019年10月21日	(4,697)
美元 2,204,765	澳元 3,259,334	2019年10月21日	(5,037)
美元 1,771,639	离岸人民币 12,618,564	2019年10月21日	(5,226)
美元 641,974	离岸人民币 4,547,096	2019年10月21日	(5,449)
美元 1,505,805	离岸人民币 10,717,488	2019年10月21日	(5,515)
美元 337,049	澳元 491,073	2019年10月21日	(5,620)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
美元 1,577,645	离岸人民币 11,228,901	2019年10月21日	(5,764)
美元 849,727	离岸人民币 6,025,731	2019年10月21日	(6,215)
美元 328,913	澳元 478,074	2019年10月21日	(6,256)
美元 505,858	纽元 795,358	2019年10月21日	(6,927)
美元 2,341,778	离岸人民币 16,678,870	2019年10月21日	(6,982)
美元 898,072	离岸人民币 6,363,811	2019年10月21日	(7,233)
美元 1,993,246	离岸人民币 14,186,991	2019年10月21日	(7,277)
美元 533,376	纽元 836,466	2019年10月21日	(8,657)
美元 528,113	澳元 769,213	2019年10月21日	(8,966)
美元 1,968,806	离岸人民币 13,989,765	2019年10月21日	(10,446)
美元 1,015,470	离岸人民币 7,175,698	2019年10月21日	(10,981)
美元 699,012	澳元 1,018,314	2019年10月21日	(11,745)
美元 3,266,931	离岸人民币 23,250,635	2019年10月21日	(12,184)
美元 1,002,354	离岸人民币 7,055,707	2019年10月21日	(14,663)
美元 1,609,014	澳元 2,349,603	2019年10月21日	(23,252)
美元 3,296,228	离岸人民币 23,348,162	2019年10月21日	(27,835)
美元 2,635,635	离岸人民币 18,624,406	2019年10月21日	(28,499)
美元 14,320,557	离岸人民币 102,012,533	2019年10月21日	(40,301)
美元 29,505,967	离岸人民币 209,237,730	2019年10月21日	(215,803)
美元 104,437,513	加元 137,916,525	2019年10月21日	(247,290)
美元 122,533,880	离岸人民币 872,870,465	2019年10月21日	(344,838)
美元 54,827,097	纽元 85,375,461	2019年10月21日	(1,270,562)
美元 547,268,556	离岸人民币 3,898,469,200	2019年10月21日	(1,540,141)
美元 140,332,012	澳元 205,011,530	2019年10月21日	(1,968,416)
美元 808,820,638	离岸人民币 5,761,636,244	2019年10月21日	(2,276,209)
林吉特 63,019,500	美元 15,000,000	2019年11月15日	(42,248)
林吉特 63,307,500	美元 15,000,000	2019年11月15日	(110,992)
林吉特 84,266,000	美元 20,000,000	2019年11月15日	(113,617)
林吉特 69,832,950	美元 16,500,000	2019年11月15日	(168,564)
美元 13,160,413	林吉特 55,000,000	2019年11月15日	(32,375)
美元 20,354,406	林吉特 85,000,000	2019年11月15日	(65,628)
美元 14,409,222	林吉特 60,000,000	2019年11月15日	(87,756)
美元 45,449,109	林吉特 190,000,000	2019年11月15日	(97,693)
美元 49,277,423	林吉特 205,886,000	2019年11月15日	(134,168)
澳元 1,864	美元 1,259	2019年11月21日	(0)
加元 5,132	美元 3,879	2019年11月21日	(1)
加元 296,321	美元 223,945	2019年11月21日	(32)
纽元 1,744	美元 1,095	2019年11月21日	(0)
英镑 893	美元 1,103	2019年11月21日	(0)
美元 161,693	离岸人民币 1,156,000	2019年11月21日	(6)
美元 794,243	离岸人民币 5,678,220	2019年11月21日	(42)
美元 1,790,909	离岸人民币 12,803,798	2019年11月21日	(68)
离岸人民币 164,510,674	美元 23,000,000	2019年11月25日	(7,521)
离岸人民币 302,143,138	美元 42,200,000	2019年11月25日	(56,009)
印尼盾 235,158,146,661	美元 16,218,922	2019年11月25日	(258,554)
印尼盾 301,220,000,000	美元 20,000,000	2019年11月25日	(1,106,413)
印度卢比 714,282,000	美元 10,000,000	2019年11月25日	(36,378)
韩元 7,903,350,000	美元 6,500,000	2019年11月25日	(100,216)
韩元 12,160,000,000	美元 10,000,000	2019年11月25日	(155,013)
韩元 39,844,200,000	美元 33,000,000	2019年11月25日	(274,538)
林吉特 273,240,500	美元 65,000,000	2019年11月25日	(210,973)
菲律宾比索 859,567,500	美元 16,500,000	2019年11月25日	(57,719)
菲律宾比索 863,890,500	美元 16,500,000	2019年11月25日	(140,993)
菲律宾比索 845,360,000	美元 16,000,000	2019年11月25日	(284,042)
新加坡元 11,109,704	美元 8,000,000	2019年11月25日	(38,860)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
新加坡元 16,644,456	美元 12,000,000	2019年11月25日	(43,745)
美元 15,513,867	林吉特 65,000,000	2019年11月25日	(1,112)
美元 8,072,411	新加坡元 11,109,704	2019年11月25日	(33,529)
美元 20,363,183	林吉特 85,000,000	2019年11月25日	(77,329)
美元 14,013,653	澳元 20,624,055	2019年11月25日	(79,906)
美元 33,534,541	韩元 40,000,000,000	2019年11月25日	(130,031)
美元 16,355,316	离岸人民币 116,000,000	2019年11月25日	(132,389)
美元 42,388,665	离岸人民币 302,143,138	2019年11月25日	(132,825)
美元 13,037,136	墨西哥比索 256,844,294	2019年11月25日	(141,520)
美元 15,966,204	澳元 23,307,612	2019年11月25日	(219,207)
美元 32,409,868	离岸人民币 230,000,000	2019年11月25日	(243,696)
美元 16,372,437	印尼盾 230,000,000,000	2019年11月25日	(257,773)
美元 14,526,934	离岸人民币 100,000,000	2019年11月25日	(542,197)
美元 14,989,580	离岸人民币 103,000,000	2019年11月25日	(585,335)
美元 70,848,625	离岸人民币 500,000,000	2019年11月25日	(922,663)
美元 78,528,355	韩元 92,749,840,000	2019年11月25日	(1,072,610)
墨西哥比索 309,662,348	美元 15,500,000	2019年12月10日	(14,301)
美元 15,683,017	墨西哥比索 309,662,348	2019年12月10日	(170,560)
美元 15,950,543	墨西哥比索 315,877,760	2019年12月19日	(147,780)
印度卢比 610,479,000	美元 8,443,284	2020年2月28日	(36,733)
美元 66,690,800	印度卢比 4,800,403,808	2020年2月28日	(9,693)
印度卢比 1,458,072,000	美元 19,800,000	2020年3月9日	(426,560)
印度卢比 2,397,525,000	美元 32,500,000	2020年3月19日	(714,216)
美元 21,026,703	离岸人民币 145,000,000	2020年5月15日	(830,348)
印度卢比 2,313,065,000	美元 31,000,000	2020年8月3日	(511,559)
		未实现总亏损	(19,437,960)

已平仓但尚未结算之合约:

印度卢比 630,855,000	美元 8,806,519	2019年11月15日	
美元 8,995,508	印度卢比 630,855,000	2019年11月15日	(188,989)
泰铢 338,789,000	美元 11,000,000	2019年11月25日	
美元 11,066,473	泰铢 338,789,000	2019年11月25日	(66,473)

未实现总亏损 (255,462)

未实现净亏损 (6,997,715)

(b) 以下为截至九月三十日之未平仓期货合约:

	合约多头/ (空头)	合约金额 美元	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
<u>2020</u>				
US Ultra Bond (CBT) Futures	71	15,825,375	2020年12月	(76,688)
				(76,688)

2019

无

13 其他收入

本年度本基金收到管理人因估值和/或其他操作错误而支付的赔偿 483,427 美元（二零一九年：无）。

独立核数师报告

致摩根亚洲总收益债券基金（“贵基金”）份额持有人

就财务报表审计作出的报告

意见

我们已审计的内容

摩根亚洲总收益债券基金列载于第八页至第四十九页的财务报表，包括：

- 于二零二零年九月三十日的财务状况表；
- 截至该日止年度的综合收益表；
- 截至该日止年度的可赎回份额持有人应占净资产变动表；
- 截至该日止年度的现金流量表；及
- 财务报表附注，包括主要会计政策概要。

我们的意见

我们认为，该等财务报表已根据香港会计师公会颁布的《香港财务报告准则》真实而中肯地反映了贵基金于二零二零年九月三十日的财务状况及其截至该日止年度的财务交易及现金流量。

意见的基础

我们已根据香港会计师公会颁布的《香港审计准则》进行审计。我们在该等准则下承担的责任已在本报告“核数师就审计财务报表承担的责任”部分中作进一步阐述。

我们相信，我们所获得的审计凭证能充足及适当地为我们的审计意见提供基础。

独立性

根据香港会计师公会颁布的《专业会计师道德守则》（“守则”），我们独立于贵基金，并已履行守则中的其他专业道德责任。

其他信息

贵基金受托人及管理人（“管理层”）须对其他信息负责。其他信息包括年报内的所有信息，但不包括财务报表及我们的核数师报告。

我们对财务报表的意见不涵盖其他信息，我们亦不对该等其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中所了解的情况存在重大抵触或者似乎存在重大错误陈述的迹象。

基于我们已执行的工作，如果我们认为其他信息存在重大错误陈述，我们需要报告该事实。在这方面，我们没有任何报告。

管理层就财务报表须承担的责任

贵基金管理层须负责根据香港会计师公会颁布的《香港财务报告准则》拟备真实而中肯的财务报表，并对其认为为使财务报表的拟备不存在由于欺诈或错误而导致的重大错误陈述所需的内部控制负责。

在拟备财务报表时，贵基金管理层负责评估贵基金持续经营的能力，并在适用情况下披露与持续经营有关的事项，以及使用持续经营为会计基础，除非管理层有意将贵基金清盘或停止经营或别无其他实际的替代方案。

另外，贵基金管理层负责确保财务报表已遵照二零零四年十一月三十日订立的信托契约（经修订）（“信托契约”）以及香港证券及期货事务监察委员会颁布的单位信托及互惠基金守则（“证监会守则”）附录 E 的相关披露条文适当地拟备。

核数师就审计财务报表承担的责任

我们的目标，是对财务报表整体是否不存在由于欺诈或错误而导致的重大错误陈述取得合理保证，并出具包括我们意见的核数师报告。我们仅向阁下（作为整体）报告我们的意见，除此之外本报告别无其他目的。我们不会就本报告的内容向任何其他人士负责或承担任何责任。合理保证是高水平的保证，但不能保证按照《香港审计准则》进行的审计，在某一重大错误陈述存在时总能发现。错误陈述可以由欺诈或错误所引起，如果合理预期它们单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依赖财务报表所作出的经济决定，则有关的错误陈述可以被视为重大。此外，我们必须评估贵基金的财务报表在所有重大方面是否已根据信托契约及证监会守则附录 E 的相关披露条文适当地拟备。

在根据《香港审计准则》进行审计的过程中，我们运用了专业判断，保持了专业怀疑态度。我们亦：

- 识别和评估由于欺诈或错误而导致财务报表存在重大错误陈述的风险，设计及执行审计程序以应对这些风险，以及获取充足和适当的审计凭证，作为我们意见的基础。由于欺诈可能涉及串谋、伪造、蓄意遗漏、虚假陈述，或凌驾于内部控制之上，因此未能发现因欺诈而导致的重大错误陈述的风险高于未能发现因错误而导致的重大错误陈述的风险。
- 了解与审计相关的内部控制，以设计适当的审计程序，但目的并非对贵基金内部控制的有效性发表意见。
- 评价管理层所采用会计政策的恰当性及作出会计估计和相关披露的合理性。

独立核数师报告（续）

致摩根亚洲总收益债券基金（“贵基金”）份额持有人

核数师就审计财务报表承担的责任（续）

- 对管理层采用持续经营会计基础的恰当性作出结论。根据所获取的审计凭证，确定是否存在与事项或情况有关的重大不确定性，从而可能导致对贵基金的持续经营能力产生重大疑虑。如果我们认为存在重大不确定性，则有必要在核数师报告中提请使用者注意财务报表中的相关披露。假若有关的披露不足，则我们应当发表非无保留意见。我们的结论是基于核数师报告日止所取得的审计凭证。然而，未来事项或情况可能导致贵基金不能持续经营。
- 评价财务报表的总体列报、结构和内容，包括披露，以及财务报表是否中肯反映交易和事项。

除其他事项外，我们与管理层沟通了计划的审计范围、时间安排、重大审计发现等，包括我们在审计中识别出内部控制的任何重大缺陷。

根据信托契约与证监会守则附录 E 的相关披露条文就相关事项作出的报告

我们认为，财务报表在各重大方面已根据信托契约及证监会守则附录 E 的相关披露条文适当地拟备。

罗兵咸永道会计师事务所

执业会计师

香港

二零二一年一月二十五日

管理人及受托人的责任声明

管理人的责任

基金管理人务必遵照香港证券及期货事务监察委员会所颁布的单位信托及互惠基金守则和信托契约编制各年度会计期间的财务报表，该等财务报表真实而中肯地反映基金于该期末的财务状况及截至该日止年度的财务交易。编制该等财务报表时，管理人务必：

- 选择并贯彻地应用适当的会计政策；
- 作出审慎和合理的判断；及
- 按持续营运的基准编制财务报表，除非该假设不恰当。

管理人亦务必遵照信托契约，采取合理措施预防和监测欺诈及其他不法行为。

受托人的责任

基金受托人务必：

- 确保管理人遵照信托契约管理本基金且确保投资及借款能力符合要求；
- 确保已保留充分的会计记录及其他记录；
- （在合理可行的情况下）保护本基金的财产及附带权利；及
- 就每一个会计年度，若管理人未按照信托契约管理本基金，则须向份额持有人报告。

受托人对份额持有人的报告

本受托人谨确认管理人于截至二零二零年九月三十日止财政年度在各个重要方面均依照二零零四年十一月三十日所订立之信托契约（经修订）之条款管理本基金。

汇丰机构信托服务（亚洲）有限公司，受托人

二零二一年一月二十五日

业绩记录 - 未经审计

资产净值

财务期结算日	本基金资产净值	每份额资产净值
30/9/20 - 澳元对冲类别（每月派息） - 加元对冲类别（每月派息） - 英镑对冲类别（每月派息） - 港元类别（每月派息） - 纽元对冲类别（每月派息） - 人民币对冲类别（累计） - 人民币对冲类别（每月派息） - 美元类别（累计） - 美元类别（每月派息） - PRC 人民币对冲份额（累计） - PRC 人民币对冲份额（每月派息） - PRC 美元份额（累计） - PRC 美元份额（每月派息）	澳元 200,080,050 加元 136,678,850 英镑 4,665,897 港元 3,917,117,050 纽元 92,667,985 人民币 15,430,879 人民币 3,618,794,584 美元 2,621,058 美元 736,162,668 人民币 2,461,936,140 人民币 754,021,450 美元 495,983,658 美元 35,772,394	澳元 8.65 加元 8.74 英镑 9.14 港元 9.28 纽元 8.61 人民币 13.82 人民币 8.97 美元 13.39 美元 10.68 人民币 13.11 人民币 9.68 美元 11.97 美元 9.73
30/9/19 - 澳元对冲类别（每月派息） - 加元对冲类别（每月派息） - 英镑对冲类别（每月派息） - 港元类别（每月派息） - 纽元对冲类别（每月派息） - 人民币对冲类别（累计） - 人民币对冲类别（每月派息） - 美元类别（累计） - 美元类别（每月派息） - PRC 人民币对冲份额（累计） - PRC 人民币对冲份额（每月派息） - PRC 美元份额（累计） - PRC 美元份额（每月派息）	澳元 205,855,872 加元 136,297,063 英镑 3,723,282 港元 3,941,035,656 纽元 88,379,459 人民币 98,885,725 人民币 3,811,348,133 美元 2,707,081 美元 557,035,318 人民币 5,711,865,861 人民币 883,011,937 美元 440,896,043 美元 38,278,097	澳元 8.90 加元 8.94 英镑 9.36 港元 9.54 纽元 8.83 人民币 13.19 人民币 9.13 美元 12.96 美元 10.86 人民币 12.53 人民币 9.86 美元 11.58 美元 9.89
30/9/18 - 澳元对冲类别（每月派息） - 加元对冲类别（每月派息） - 英镑对冲类别（每月派息） - 港元类别（每月派息） - 纽元对冲类别（每月派息） - 人民币对冲类别（累计） - 人民币对冲类别（每月派息） - 美元类别（累计） - 美元类别（每月派息） - PRC 人民币对冲份额（累计） - PRC 人民币对冲份额（每月派息） - PRC 美元份额（累计） - PRC 美元份额（每月派息）	澳元 151,437,984 加元 109,956,213 英镑 2,722,720 港元 2,370,395,595 纽元 56,146,414 人民币 18,776,312 人民币 3,249,538,350 美元 1,974,794 美元 371,634,095 人民币 1,721,353,017 人民币 611,206,738 美元 494,672,657 美元 22,623,212	澳元 8.61 加元 8.66 英镑 9.06 港元 9.22 纽元 8.55 人民币 12.13 人民币 8.84 美元 11.98 美元 10.51 人民币 11.52 人民币 9.55 美元 10.70 美元 9.58

业绩记录 - 未经审计 (续)

最高卖出价/最低买入价

(续)

财务期结算日	最高卖出价	最低买入价	财务期结算日	最高卖出价	最低买入价
30/9/20			30/9/16		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.01	澳元 7.92	- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.65	澳元 9.01
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.06	加元 8.00	- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.68	加元 9.03
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 9.47	英镑 8.36	- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.11	英镑 9.41
- 港元类别 (每月派息)	港元 9.61	港元 8.51	- 港元类别 (每月派息)	港元 10.20	港元 9.53
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 8.94	纽元 7.88	- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.58	纽元 8.94
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 13.89	人民币 12.16	- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 11.82	人民币 10.36
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 9.24	人民币 8.23	- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 9.95	人民币 9.26
- 美元类别 (累计)	美元 13.49	美元 11.93	- 美元类别 (累计)	美元 12.29	美元 11.09
- 美元类别 (每月派息)	美元 10.99	美元 9.79	- 美元类别 (每月派息)	美元 11.73	美元 10.93
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 13.17	人民币 11.57	- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 11.00	人民币 10.02
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 9.98	人民币 8.89	- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.53	人民币 10.00
- PRC 美元份额 (累计)	美元 12.05	美元 10.66	- PRC 美元份额 (累计)	美元 10.77	美元 9.96
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.02	美元 8.92	- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.49	美元 9.96
30/9/19			30/9/15		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 8.98	澳元 8.48	- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.97	澳元 9.05
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.02	加元 8.53	- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.95	加元 9.07
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 9.43	英镑 8.92	- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.35	英镑 9.45
- 港元类别 (每月派息)	港元 9.64	港元 9.07	- 港元类别 (每月派息)	港元 10.46	港元 9.53
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 8.91	纽元 8.42	- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.90	纽元 8.98
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 13.21	人民币 12.01	- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 10.92	人民币 10.12
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 9.22	人民币 8.71	- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.32	人民币 9.32
- 美元类别 (累计)	美元 12.98	美元 11.84	- 美元类别 (累计)	美元 11.83	美元 11.06
- 美元类别 (每月派息)	美元 10.96	美元 10.35	- 美元类别 (每月派息)	美元 12.04	美元 10.97
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 12.55	人民币 11.41			
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 9.96	人民币 9.40			
- PRC 美元份额 (累计)	美元 11.60	美元 10.58			
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 9.99	美元 9.43			
30/9/18			30/9/14		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.14	澳元 8.54	- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.05	澳元 9.41
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.18	加元 8.58	- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.06	加元 9.42
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 9.59	英镑 8.97	- 港元类别 (每月派息)	港元 10.54	港元 9.89
- 港元类别 (每月派息)	港元 9.76	港元 9.17	- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.00	纽元 9.36
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.07	纽元 8.47	- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 10.49	人民币 10.01
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 12.32	人民币 11.88	- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.41	人民币 9.91
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 9.38	人民币 8.78	- 美元类别 (累计)	美元 11.61	美元 10.53
- 美元类别 (累计)	美元 12.30	美元 11.75	- 美元类别 (每月派息)	美元 12.13	美元 11.36
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.13	美元 10.42			
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 11.72	人民币 11.30			
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.14	人民币 9.48			
- PRC 美元份额 (累计)	美元 10.99	美元 10.49			
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.15	美元 9.49			
30/9/17			30/9/13		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.56	澳元 8.99	- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.46	澳元 9.29
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.60	加元 9.03	- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.46	加元 9.29
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.04	英镑 9.43	- 港元类别 (每月派息)	港元 10.94	港元 9.73
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.12	港元 9.51	- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.42	纽元 9.24
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.50	纽元 8.93	- 美元类别 (累计)	美元 11.40	美元 10.28
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 12.11	人民币 11.20	- 美元类别 (每月派息)	美元 12.58	美元 11.19
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 9.86	人民币 9.20			
- 美元类别 (累计)	美元 12.24	美元 11.60			
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.63	美元 10.95			
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 11.51	人民币 10.63			
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.42	人民币 9.92			
- PRC 美元份额 (累计)	美元 10.88	美元 10.36			
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.38	美元 9.98			
			30/9/12		
			- 港元类别 (每月派息)	港元 10.68	港元 9.91
			- 美元类别 (累计)	美元 10.87	美元 9.97
			- 美元类别 (每月派息)	美元 12.29	美元 10.48
			30/9/11		
			- 美元类别 (每月派息)	美元 11.96	美元 10.68

经营与管理

管理人及服务提供者

摩根基金（亚洲）有限公司
香港
中环干诺道中 8 号
遮打大厦 21 楼

投资管理人

摩根资产管理
（亚太）有限公司
香港
中环干诺道中 8 号
遮打大厦 21 楼

助理管理人

JPMorgan Asset Management
(UK) Limited
60 Victoria Embankment
London
EC4Y 0JP
United Kingdom

管理人董事

于二零二一年一月二十五日
Ayaz Hatim EBRAHIM
Daniel James WATKINS
Edwin Tsun Kay CHAN
Elka Kit Yee LEUNG

受托人

汇丰机构信托服务
（亚洲）有限公司
香港
中环皇后大道中 1 号

基金注册登记机构

HSBC Trustee (Cayman) Limited
P.O. Box 309
Ugland House
Grand Cayman KY1-1104
Cayman Islands

核数师

罗兵咸永道会计师事务所
执业会计师
香港
中环德辅道中 1 号
太子大厦 22 楼

